

论文

从停止问题到折扣费用问题

刘坤会

北方交通大学数学系,北京100044

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文借助一类停止问题,研究了奇异型折扣费用问题,得出了最佳控制的存在性及结构形式.其模型为设 (Ω, \mathcal{F}, P) 为某概率空间, $w_t, t \geq 0$ 为其上 Wiener 过程, $\mathcal{F}_t = \sigma(w_s, 0 \leq s \leq t)$. 以 \mathcal{B} 表 \mathcal{F}_t 适应左连续0初值有限变差过程的全体. 对 $\forall \xi = \{\xi, t \geq 0\} \in \mathcal{B} \dots$

关键词

分类号

FROM STOPPING PROBLEMS TO DISCOUNTED PROBLEMS

LIU KUN-HUI

Department of Mathematics, Northern Jiaotong University, Beijing 100044

Abstract Using a class of stopping problems, this paper studies the discounted problem and gives the existence and structure of its optimal control.

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(168KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 无 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [刘坤会](#)