

<<随机积分与不等式>>

图书基本信息

书名：<<随机积分与不等式>>

13位ISBN编号：9787030149428

10位ISBN编号：7030149424

出版时间：2005-2

出版时间：科学分社

作者：闫理坦，鲁立刚，许志强

页数：192

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<随机积分与不等式>>

内容概要

《随机积分与不等式》讨论了在随机积分中的一些不等式，着重介绍随机不等式，特别是关联于连续过程的不等式。

《随机积分与不等式》分为两个部分：第一部分介绍连续鞅、连续积分与随机微分方程；第二部分介绍近年来在连续鞅与随机微积分中发现的不等式，其中一些结果是作者的最新研究成果。

《随机积分与不等式》可供高等院校数学系高年级本科生、研究生和从事随机分析研究工作的数学工作者阅读。

<<随机积分与不等式>>

书籍目录

前言
第一部分 连续鞅与随机积分的准备
第1章 连续鞅
1.1 过程与停时
1.2 Doob收敛定理与一致可积性
1.3 Doob不等式
1.4 Doob-Meyer分解
1.5 二次变差
1.6 H_2 -空间
第2章 随机积分
2.1 随机积分的定义
2.2 Itô公式
2.3 适应于Brown流的局部鞅
2.4 局部鞅与Brown运动的时变
2.5 指数鞅与Girsanov变换
2.6 局部时
第3章 随机微分方程浅说
3.1 强解
3.2 弱解
3.3 一维随机微分方程
3.4 扩散
3.5 两个例子
第二部分 一些随机不等式
第4章 B-D-G等式及其扩张
4.1 B-D-G不等式
4.2 被在任意时间停止的鞅不等式
4.3 非缓变函数不等式
第5章 局部时的不等式
5.1 Barlow-Yor不等式
5.2 Brown局部时Cauchy主值的不等式
第6章 BMO-鞅与不等式
6.1 BMO-鞅
6.2 Fefferman不等式
6.3 John-Nirenberg不等式
6.4 Garnett-Jones不等式
6.5 (A_p) 条件与逆Hölder不等式
6.6 鞅的赋权模不等式
第7章 重随机积分的一些不等式
7.1 极大值不等式
7.2 比率不等式
第8章 扩散过程的一些不等式
8.1 一个积分泛函
8.2 Ornstein-Uhlenbeck过程的不等式
8.3 Bessel过程的不等式
参考文献

<<随机积分与不等式>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>