

非线性期望下随机过程的结构与性质

宋永生 (中科院 数学院)

摘要: 报告中, 我首先介绍非线性期望的一些基本概念. 然后重点介绍非线性期望下几类随机过程的结构与性质, 包括非线性鞅的表示, 非线性伊藤过程分解的唯一性等.