

COMPARAISON ET NON-CONFLUENCE DES SOLUTIONS D'ÉQUATIONS
DIFFÉRENTIELLES STOCHASTIQUES UNIDIMENSIONNELLES

Youssef Ouknine

Abstract: Dans ce papier nous établissons un théorème général de comparaison des E.D.S. Les résultats que nous avons obtenus étendent ceux de [11] et [6]. Lorsque les coefficients de diffusion sont les mêmes, nous retrouvons les théorèmes de comparaison de [4].

La non-confluence des solutions d'E.D.S. a été étudiée par Emery [2], Uppman [12], Yor [15] et Revuz-Yor [10]; tous ces auteurs considèrent des E.D.S. à coefficients lipschitziens.

Un résultat récent de Yamada [13] étudie la non-confluence pour les E.D.S. homogènes à coefficient de diffusion non dégénéré. On se propose de généraliser le résultat de [13] et d'en donner une démonstration sans régularisation des coefficients. Notre méthode est basée sur les martingales exponentielles et un lemme de Yoeurp-Yor [16].

2000 AMS Mathematics Subject Classification: Primary: -; Secondary: -;

Key words and phrases: -

THE FULL TEXT IS AVAILABLE [HERE](#)