

对称马氏过程的Girsanov变换

陈传钟

海南师范学院数学系, 海口 571158

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文讨论一类对称马氏过程的Girsanov变换, 这类

Girsanov变换是由该对称马氏过程所联系的狄氏型定义域中的函数来确定的. 我们证明了对称马氏过程

经变换后还是对称的马氏过程, 并且给出经变换后的马氏过程

所联系的狄氏型. 这些结果将前人的相应结论从有界函数推广到更有应用意义的一类无界函数之上.

关键词 [对称狄氏型](#) [对称马氏过程](#) [Girsanov变换](#)

分类号

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“对称狄氏型”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
- [陈传钟](#)

Abstract In this paper, we study a class Girsanov-type transformations of an arbitrary symmetric Markov process X by $\mathcal{D}(E)$. We prove the transformed process \widehat{X} is a symmetric Markov process also and characterize the Dirichlet forms associated with the transformed process \widehat{X} . Our results extend the earlier works.

Key words [symmetric dirichlet form](#) [symmetric Markov process](#) [Girsanov transform](#)

DOI:

通讯作者 czchen@hainnu.edu.cn