

二参数Ornstein-Uhlenbeck过程最大值分布估计

罗首军

南开大学数学系

收稿日期 1986-8-7 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文研究二参数 Ornstein-Uhlenbeck 过程 $X(t), t \in \mathbb{R}^2$ 的极大值问题,得到了 $\Pr\{\max(X(t), t \in [0, T]) > y\}$ 上、下界的一个估计式与 $\Pr\{\max(x(t), t \in D) > y\}$ 的渐近公式,其中 D 是 \mathbb{R}^2 中的有界 Lebesgue 可测集.

关键词

分类号

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者

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 无 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
- [罗首军](#)