应用概率统计　2008 24 (2): 148-156　ISSN: 1001-4268　CN: 4-414

学术论文

多维局部平稳高斯过程最大值的联合渐近分布

杨春华,彭作祥

渝西学院数学系, 西南师范大学数学系

收稿日期　修回日期　网络版发布日期:

摘要　$\{(X_1(t),\cdots,X_p(t)),0\leq t\leq T\}$为$p$维局部平稳高斯过程, 具有渐近中心化的均值$m_k(t)$和常数的方差, $M_k(T)=\sup\{X_k(t),0\leq t\leq T\},\;k=1,\cdots,p$, 当$T\rightarrow\infty$时, 本文在一定条件下获得了$M(T)=(M_1(T),\cdots,M_p(T))$的联合渐近分布.

关键词　多维高斯过程, 局部平稳高斯过程, 最大值.

分类号

扩展功能

本文信息

- Supporting info
- PDF(211KB)
- [HTML全文](0KB)
- 参考文献

服务与反馈

- 把本文推荐给朋友
- 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“多维高斯过程, 局部平稳高斯过程, 最大值.”的 相关文章
- 本文作者相关文章
  - 杨春华
  - 彭作祥

Asymptotic Distribution of Maxima Multivariate Locally Stationary Gaussian Processes

Yang Chunhua, Peng Zuoxiang

Department of Mathematics, YUXi University; Department of Mathematics, Southwest Normal University

Abstract Let $\{(X_1(t),\cdots,X_p(t)),0\leq t\leq T\}$ be p dimensional locally stationary Gaussian processes with asymptotically centered mean $m_k(t)$, $k=1,\cdots,p$ and constant variance. $M_k(T)=\sup\{X_k(t),0\leq t\leq T\}$, $k=1,\cdots,p$. Under some conditions, the asymptotic distribution of $M(T)=(M_1(T),\cdots,M_p(T))$ as $T\rightarrow\infty$ is obtained.

Key words　Multivariate Gaussian processes, locally stationary Gaussian processes, maxima.

DOI

通讯作者　杨春华