

应用数学与基础数学

重尾分布类 $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ 中负相伴随机变量和的精确大偏差

汪世界^{1, 2}, 王文胜¹

1. 华东师范大学~金融统计学院, 上海 200241;
2. 安徽大学~数学科学学院, 合肥 230039

收稿日期 2008-7-2 修回日期 2008-12-6 网络版发布日期 2009-7-7 接受日期 2009-3-6

摘要 利用重尾分布类 $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ 性质的刻画, 得到了重尾分布类 $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ 中负相伴随机变量和(随机和与非随机和)的精确大偏差, 而重尾分布类 $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ 是严格包含 \mathcal{C} 的, 从而首次将现有的精确大偏差结果推广到更大的重尾分布子类上

关键词 [负相伴](#); [一致变化尾](#); [控制变化尾](#); [长尾](#); [精确大偏差](#)

分类号 [0211.4](#)

Precise large deviation for sums of negatively associated $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ heavy-tailed random variables

WANG Shi-jie^{1, 2}, WANG Wen-sheng¹

1. School of Finance and Statistics, East China Normal University, Shanghai 200241, China

Abstract

By using the characterization of heavy-tailed random variables in $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$, precise large deviations for sums (nonrandom sums and random sums) of negatively associated heavy-tailed random variables in $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ were obtained, where the subclass $\mathcal{D} \cap \mathcal{L}$ strictly contains \mathcal{C} . Therefore, it firstly extends some existed precise large deviation results to some larger subclasses of heavy tailed distributions.

Key words [negatively association](#) [consistently varying tail](#) [dominately varying tail](#) [long tail](#) [precise large deviation](#)

DOI:

通讯作者 汪世界 ahuwsj@126.com

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(249KB\)](#)
- ▶ [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](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“负相伴; 一致变化尾; 控制变化尾; 长尾; 精确大偏差” 的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
- [汪世界](#)
-
- [王文胜](#)