

# 超Ornstein-Uhlenbeck过程的一个渐近行为

唐加山

南京邮电学院数理系,南京210003

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 本文考虑底过程为暂留的超Ornstein-Uhlenbeck过程的击中概率问题,通过研究一类奇异边值问题的解,给出过程击中概率的一个渐近行为.

**关键词** [超O-U过程,击中概率,奇异边值问题,渐近性](#)

分类号

## AN ASYMPTOTIC BEHAVIOR OF SUPER ORNSTEIN-UHLENBECK PROCESSES

Jia Shan TANG

Department of Applied Mathematics and Physics, Nanjing University of Posts and Telecommunications, Nanjing 210003,P.R.China

**Abstract** In this paper, we deal with the super Ornstein-Uhlenbeck processes with transient underlying processes, and give an asymptotic behavior of hitting probabilities of these processes.

**Key words** [Super Ornstein-Uhlenbeck process](#) [hitting probability](#) [singular boundary value problem](#)

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 包含“超O-U过程,击中概率,奇异边值问题,渐近性”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)
- [唐加山](#)