

暂留Brown运动的极大游程与极小游程

吕玉华, 徐润, 尹传存

曲阜师范大学数学系, 曲阜273165

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 对于暂留Brown运动, 我们给出了极大游程与极小游程的若干定义, 并且求出了极大游程(极小游程)的分布, 以及极大游程(极小游程)与首达极大时(首达极小时)的联合分布. 作为推论求出了首达极大时与首达极小时的分布.

关键词 [暂留Brown运动](#), [极大游程](#), [极小游程](#), [首中时](#), [末离时](#)

分类号

MAXIMUM EXCURSION AND INFIMUM EXCURSION FOR A TRANSIENT BROWNIAN MOTION

Yu Hua LU, RUN XU, Chuan Cun YIN

Department of Mathematics, Qufu Normal University, Qufu 273165, P.R.China

Abstract For a transient Brownian motion, we give some definitions of maximum excursion and infimum excursion. We obtain their distributions, and the joint distributions of maximum (infimum) excursion and the first instance of attaining such a maximum (infimum). As a consequence, we obtain the distribution functions of the first instance of attaining such a maximum and the first instance of attaining such a infimum.

Key words [Transient t Brownian motion](#) [maximum excursion](#) [infimum excursion](#) [first hitting time](#)

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“暂留Brown运动, 极大游程, 极小游程, 首中时, 末离时”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [吕玉华](#)
- [徐润](#)
- [尹传存](#)