

ウィナー測度に対するペナルティ法

B. Roynette, P. Vallois and M. Yor

Abstract

d次元ウィナー測度に対する様々なペナルティ法によって多くの極限法則が得られることを示し, その詳しい性質を経路の分解を用いて調べた.