

研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程： 2005年10月27日(木)～10月29日(土)

場所： 統計数理研究所 2階 会議室

***** 10月27日(木)午後 *****

13:30 - 14:15

笠原 勇二 (筑波大学大学院・数理物質科学研究科)

「completely monotone な Lévy measure を持つ加法過程について」

14:30 - 15:15

青山 崇洋 (慶應義塾大学・理工学研究科)

「Characterizations of Subclasses of Type G Distributions on R^d by Stochastic Integral Representations」

15:30 - 16:15

前島 信 (慶應義塾大学・理工学部)

「タイプGかつ自己分解可能な分布のあるサブクラスについて」

16:30-17:15

志賀 徳造 (東京工業大学大学院・理工学研究科)

「Infinite divisible RPDs and their application to a random motion in a random environment」

***** 10月28日(金)午前 *****

10:00 - 10:45

宮原 孝夫 (名古屋市立大学・経済学研究科)

「幾何レヴィ過程のマルチンゲール測度について」

11:00 - 11:45

石川 保志 (愛媛大学・理学部)

「Malliavin calculus applied to mathematical finance and a new integration -by-parts formula」

昼休み (12 : 00 - 13 : 30)

***** 10月28日(金)午後

13:30 - 14:15

佐藤 健一

「Lévy 過程による確率積分の2つの族」

14:30 - 15:15

矢野 孝次 (京都大学数理解析研究所)

「流出境界を持つ1次元拡散過程の excursion 測度について」

15:40 - 16:25

Short Communications

清水昭信、 渡部 俊朗、 志村・渡部

懇親会 (18:00 ~ 新中国家庭料理「浅野」)

***** 10月29日(土)午前

10:00 - 10:45

高橋 弘 (松江高専)

「Continuous time random walks の極限過程としての operator semi-selfsimilar process」

11:00 - 11:45

鍛治 俊輔 (大阪大学・理学研究科)

「The tail estimation of predictable quadratic variation of quasi left continuous local martingales」

12:00 - 12:30

林 聡美*、榎本 安宏*、林 弘子**、竹中 茂夫***

(*岡山理科大学大学院修了、 **岡山理科大学大学院、 ***岡山理科大学)

「安定型乱数の発生について」