

共同研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程：2014年11月27日（木）13:30～29日（土）12:20

場所：統計数理研究所3Fセミナー室5（立川市緑町10-3）

\*\*\*\*\* 11月27日（木）午後 \*\*\*\*\*

13:30-14:20 山里真（琉球大）

On bell-shape property of distributions in a subclass of infinitely divisible distributions on  $\mathbb{R}$  and applications

14:30-15:20 佐藤健一

Extension of the study of improper stochastic integrals

15:40-16:30 西郷達彦（山梨大）

記録値の極限分布

16:40-17:30 矢野孝次（京大）

Conditioning and penalization in various clocks

\*\*\*\*\* 11月28日（金）午前 \*\*\*\*\*

9:30-10:20 山野辺貴信（北大）・石川保志（愛媛大）

jump-diffusion 過程をノイズ項として含む神経細胞膜電位モデルとその確率解析

10:30-11:00 笠原勇二（筑波大）

Stieltjes 変換の調和平均に関するタウバー型定理

11:10-11:40 中田寿夫（福教大）

一般化されたペテルスブルグのゲームの極限分布について

11:50-12:30 川西泰裕（中央大）・藤田岳彦（中央大）

ブラック・ショールズモデルと CGMY モデルの下でのルックバックパワーオプションの価格付け

Lunch Time (12:30 - 14:00)

\*\*\*\*\* 11月28日(金)午後 \*\*\*\*\*

■【特別講演】■

14:00-14:50, 15:00-15:50 飛田武幸(名大・名城大)  
レヴィ過程とノイズ

16:05-16:55 道工勇(埼玉大)  
積分方程式と不偏推定量

17:10- ショートコミュニケーションズ  
竹内敦司(大阪市大) Bismut formula for SDE with jumps

18:30- 懇親会 我楽多家(立川南駅から徒歩すぐ)立川市柴崎町2-3-3 林ビルB1F

\*\*\*\*\* 11月29日(土)午前 \*\*\*\*\*

9:30-10:20 高橋弘(日大)  
The dichotomy of recurrence and transience of multi-dimensional Brox-type diffusion processes in semi-stable Lévy · environments (joint work with Sei. Kusuoka and Y. Tamura)

10:30-11:20 鍛冶俊輔(九産大)  
The first passage time of a one-side moving boundary by Lévy processes with exponentially distributed positive jumps

11:30-12:00 松井宗也(南山大)  
Prediction problems in Poisson cluster models(joint work with Tomasz Rolski)

12:00-12:20 佐久間紀佳(愛教大)  
Generalized gamma convolutions と Markov 変換

\*\*\*\*\*

研究代表者：志村 隆彰(統計数理研究所)

<お知らせ>

入館証着用について

本年度より会期中、入館証の着用をお願いいたします。

会場受付の脇に置きますので名簿記入後お取りいただき、お帰りの際お戻しくだ

さい。

#### ショートコミュニケーションズについて

- ・ショートコミュニケーションズ (S.C.) は当日昼頃まで受け付けしておりますが、事前にお知らせ頂ければ早めに HP などに掲載します。
- ・予稿集への掲載も受け付けております。

#### 28日(金) 昼食に関して

- ・事前に希望する方については仕出し弁当を予約手配をいたします。つきましては、メール、或いは会場で当日の講演開始までに申し込み用紙にご記入ください。値段は 370 円と 420 円の 2 種類です。集金は 27 日午後の休憩時と 28 日朝にいたします。

・そのほかには、下記のような方法で各自お願いいたします。

1. 持参いただく (モノレール高松駅にはないので立川駅までに購入する必要があります)。
2. 統数研の一階に来る弁当屋 (4 店) で購入する。売り切れの心配があるので、昼休みひとつ前の休み時間での購入をお勧めします。
3. 付近の市役所、裁判所などの食堂を利用する。

#### 懇親会について

- ・28日(金)の夜に立川駅周辺で懇親会を開催します。予約しますので、参加を希望される方は志村までお知らせください。会場未定なままですみませんが、メールで通知する締切日までにご連絡くださりますようお願いいたします。

#### 土曜日の入所について

- ・最終日 29 日 (土) は、正面玄関が開いていても脇 (正面玄関東、高松駅側) の警備員室入口から入り、名簿チェックを受けてください。警備上の理由で、前日までの参加者と土曜のみ参加されることをあらかじめお知らせいただいた方は警備員室に名簿を提出してあります。それ以外の方は警備員室で名簿に記名をお願いいたします。