

課題番号 27-共研-5009

## 共同研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程：2015年12月3日（木）13:30～5日（土）12:30

場所：統計数理研究所3Fセミナー室5（立川市緑町10-3）

\*\*\*\*\* 12月3日（木）午後 \*\*\*\*\*

13:30-14:20 佐久間 紀佳（愛教大）  
自由無限分解可能分布の単峰性について

14:30-15:20 佐藤 健一  
加法過程の例

15:40-16:30 塚田 大史（大阪市立大）  
安定過程に対する田中の公式

16:40-17:10 西郷 達彦（山梨大）  
多次元の極値について

\*\*\*\*\* 12月4日（金）午前 \*\*\*\*\*

10:00-10:50 石川 保志（愛媛大）・山野辺 貴信（北大）  
Nerve cell model and asymptotic expansion (2)

11:00-11:50 鈴木 良一（慶應大）  
Local risk minimization for multidimensional Lévy markets

12:00-12:30 笠原 勇二（筑波大）  
Bessel Like Diffusion の first hitting time について

**Lunch Time (12:30 - 14:00)**

\*\*\*\*\* 12月4日(金)午後 \*\*\*\*\*

■【特別講演】■

14:00-14:50, 15:00-15:50 新井 拓児 (慶大経済)  
数理ファイナンスに現れる Lévy 過程

16:10-16:40 中田 寿夫 (福教大)  
無限大の期待値をもつ重みつき of 独立な確率変数列に関する大数の弱法則  
の例

16:50- ショートコミュニケーションズ

18:30- 懇親会 塚田農場 立川南口店 (予約制)  
050-5281-0800 立川市柴崎町 3-6-30 中晋ビル 6F

\*\*\*\*\* 12月5日(土)午前 \*\*\*\*\*

10:00-10:50 道工 勇 (埼玉大)  
環境依存型モデルの極限定理について  
On a limit theorem for environment-dependent models

11:00-11:50 鍛冶 俊輔 (九産大)  
The first passage problems over increasing boundaries for Lévy processes  
with exponentially decayed jumps

12:00-12:30 野場 啓 (京大)  
屈折レヴィ過程の一般化と脱出問題

\*\*\*\*\*

研究代表者： 志村 隆彰 (統計数理研究所)

\*\*\*\*\*

## お知らせ/連絡事項

### 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。

### 懇親会について

- ・12月4日(金)に懇親会を開催します。詳細は改めてメールあるいはHP (<http://www.ism.ac.jp/~shimura/>) でお知らせします。
- ・事前予約をしますのでご協力ください。

### 4日(金)昼食に関して

- ・数研の昼食環境は十分ではないので、希望する方には仕出し弁当を予約手配をいたします。つきましては、志村宛のメールでご連絡または、会場に申込み用紙を準備しますので当日の講演開始までにご記入ください。
- ・370円と420円の2種類があります。集金は3日午後の休憩時と4日朝にいたします。

### 入館証着用について

訪問者には首にかける入館証をお付けいただくことになっております。入館証は毎日お帰りの際に返却ください。

### 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。

いろいろとお手数をおかけいたしますが、ご協力よろしく願いいたします。