

目 次

山里 眞 (琉球大学)	1
On bell-shape property of distributions in a subclass of infinitely divisible distributions on \mathbb{R} and applications	
佐藤 健一	2
加法過程の収束	
西郷 達彦 (山梨大学)	11
記録値の極限分布	
矢野 孝次 (京都大学)・矢野 裕子 (京都産業大学)	16
一次元拡散過程に対する原点回避条件付け	
山野辺 貴信 (北海道大学)・石川 保志 (愛媛大学)	21
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	
笠原 勇二 (筑波大学)	28
Stieltjes 変換の調和平均に関するタウバー型定理	
中田 寿夫 (福岡教育大学)	34
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	
川西 泰裕 (中央大学)・藤田 岳彦 (中央大学)	44
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	
【特別講演】	
飛田 武幸 (名古屋大学・名城大学)	59
レヴィ過程とノイズ	
道工 勇 (埼玉大学)	68
Integral equation and unbiased estimator	

竹内 敦司 (大阪市立大学)	74
Bismut formula for SDE with jumps	
楠岡 誠一郎 (東北大学) · 高橋 弘 (日本大学) · 田村 要造 (慶應義塾大学)	79
The dichotomy of recurrence and transience of multi-dimensional Brox-type diffusion processes in semi-stable Lévy environments	
鍛冶 俊輔 (九州産業大学)	83
The first passage time of a one-side moving boundary by Lévy processes with exponentially distributed positive jumps	
松井 宗也 (南山大学) · Tomasz Rolski (Univ. of Wrocław)	92
Some properties of mixed Poisson processes	
佐久間 紀佳 (愛知教育大学) · Octavio Arizmendi (CIMAT)	96
Generalized gamma convolutions である分布を mixture of exponential distributions とみたときの混合測度について	