

共同研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程： 2008年11月6日(木) 11月8日(土)
場所： 統計数理研究所 2階 会議室

***** 11月6日(木)午後 *****

13:30-14:20 笠原 勇二 (筑波大)
Krein-Kotani の対応へのレヴィ過程の応用

14:30-15:20 竹内 敦司 (大阪市立大)
Sensitivity analysis for Lévy-driven SDEs

15:40-16:30 謝 賓 (信州大)・舟木 直久 (東大)
Lévy 過程の分布を不変測度に持つ確率熱方程式

16:40-17:30 前島 信 (慶応大)
Type A distributions on R^d
(佐藤健一と Victor Perez-Abreu との共同研究)

***** 11月7日(金)午前 *****

9:30-10:20 佐久間 紀佳 (慶応大)・Victor Perez-Abreu (CIMAT)
Free generalized gamma convolutions

10:30-11:20 鍛冶 俊輔 (大阪大)・Alexander Novikov (University of
Technology, Sydney)
ギャンブル戦略とマルチンゲール

11:30-12:00 前島 信 (慶応大)
Bifractional Brownian motion について (Ciprian Tudor との共同研究)

昼 休 み (12:00 - 13:30)

***** 11月7日(金)午後 *****

【招待講演】松本 裕行(名古屋大)

13:30-14:20

一般化逆ガウス分布に関連する話題 1

14:30-15:20

一般化逆ガウス分布に関連する話題 2

15:40-16:20 山室 考司(岐阜大)・渡部 俊朗(会津大)

裾の重い無限分解可能分布について

S.C. (当日まで受付)

16:40- 清水 昭信(名古屋市立大)

ランダム離散分布にもとづく抽出公式についての一つの注意

西山 陽一(統数研)

Donsker's theorem for discretized data

18:30- 懇親会 「広尾の空」

<http://www.ehills.co.jp/rp/dfw/EHILLS/townguide/lunch/72hiroo.php>

(* 参加申込は 10/30 までに志村へ メールをお願いします。)

***** 11月8日(土)午前 *****

10:00-10:50 石川 保志・森本 宏明(愛媛大)

Optimal consumption control problem associated with jump-diffusion processes

11:00-11:50 千代延 大造・外村 真也(関西学院大)

自己相似 Fragmentation 連鎖 に対する大偏差原理について

12:00-12:30 志村 隆彰(統数研)

最大値吸引領域の離散化