

課題番号 30-共研-5011

共同研究集会「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程：2018年12月13日(木)13:15~12月15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13日(木)午後 *****

13:15-14:00 山里 眞（東京女子大）
Boundedness of densities of CME-subordinators

14:10-14:55 西岡 國雄（中央大企業研）
Lundberg 不等式の拡張
An extension of Lundberg's inequality

15:10-15:55 塚田 大史（京大）
Pathwise uniqueness of SDEs driven by Cauchy processes with drift

16:05-16:50 小川 重義（立命館大）
On the natural SFT and stochastic integrals

17:00-17:30 西郷 達彦（山梨大）
作用素的な最大値自己分解可能分布
Max operator selfdecomposable distributions

***** 12月14日(金)午前 *****

9:30-10:15 野場 啓（京大）
負スペクトル Lévy 過程における Poisson 的配当の最適化問題
On optimal periodic dividend strategies for Lévy risk processes

10:25-11:10 世良 透（京大）
Functional limit theorem for sojourns near indifferent fixed points

11:20-12:05 伊藤 悠（京産大）・世良 透（京大）・矢野 孝次（京大）
Resolution of sigma-fields for multiparticle finite-state evolution with infinite past

Lunch Time (12:05 - 13:10)

***** 12月14日(金)午後 *****

【招待講演】

Víctor Rivero 氏 (CIMAT・京都大学スーパーグローバルコース特別招へい教授)

13:10-14:00 Stable processes in cones

14:10-15:00 Hitting distributions of the sphere for stable processes

15:15-16:00 山戸 康祐 (京大)

A limit theorem for inverse local times of jumping-in diffusion processes

16:10-16:55 鈴木 良一 (慶應大)

Lévy 市場におけるデジタルオプションに対する局所的リスク最小化ヘッジ戦略について

On a locally risk-minimizing hedging strategy for digital option in a Lévy market

17:00～ ショートコミュニケーションズ

中田 寿夫 (福岡教育大学)

期待値の発散するパレート分布についての重みつきの大数の法則

Weighted Laws of large numbers for independent Pareto random variables with infinite mean

懇親会 時間：18:30 -20:30 ブラッスリー アミカル

<https://www.brasserie-amicale.com/> 詳細は下記連絡事項をご覧ください。

***** 12月15日(土)午前 *****

9:30-10:15 植田 優基 (北大)

Free multiplicative convolution with free circular normal distributions and its properties

10:25-11:10 高橋 弘 (東京学芸大)

Random processes on disconnected self-similar fractal sets in \mathbb{R}

11:20-11:50 古城 克也 (新居浜高専)

スペクトル測度が point mass だけで構成される多次元対称安定分布の決定性について

On the determinism of multivariate symmetric stable distributions whose spectral measures are constructed by point masses

12:00-12:30 佐久間 紀佳 (愛教大)

コーシー変換で表されるキュムラントについて

On the cumulant and Cauchy transform

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14日(金)に懇親会を開催します。詳細決まりましたら改めて連絡いたします。事前予約制で人数把握のため、参加を希望される方はご協力ください。

会費：5千円+ α

14日(金)昼食に関して

- ・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、志村宛のメールへご連絡くださるか、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。
- ・400円と450円の2種類があります。集金は13日(木)午後の休憩時及び14日講演開始前にいたします。

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15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、ご協力よろしくをお願いいたします。