

統計数理研究所共同研究集会 課題番号 2019-ISMCRP5003

「無限分解可能過程に関連する諸問題」

日程：2019年11月7日(木)14:00～11月9日(土)12:10

場所：統計数理研究所3F セミナー室5 (東京都立川市緑町10-3)

***** 11月7日(木) 午後 *****

14:00 - 14:40 世良 透(京大)

A conditional limit theorem for intermittent dynamical systems

14:50 - 15:50 【特別講演】石川 保志(愛媛大)

Stochastic analysis on the Wiener-Poisson space and its application to the nerve cell models (I)

16:00 - 16:40 西岡 國雄(中央大企業研)

Estimations of ruin probabilities (存続確率の上下評価)

16:50 - 17:20 西郷 達彦(山梨大)

Selfsimilarity related to EVT (極値に関わる自己相似性)

***** 11月8日(金) 午前 *****

9:30 - 10:10 野場 啓(阪大)

On the bail-out dividend problem for spectrally negative Markov additive models (joint work with José -Luis Pérez and Xiang Yu)

10:20 - 11:00 鍛冶 俊輔(名城大)

First passage times over increasing boundaries for Lévy processes with positive means

11:10 - 11:50 竹内 敦司(東京女子大)

Gradient formula for jump processes on Riemannian manifolds

12:00 - 12:40 土谷 正明(金沢大)

Martingale problem for the generalized Lévy generator determined by a bundle of generating triplets of natural additive processes

Lunch Time (12:40 - 14:00)

***** 11月8日(金)午後 *****

14:00 - 15:00 【特別講演】石川 保志(愛媛大)

Stochastic analysis on the Wiener-Poisson space and its application to the nerve cell models (II)

15:10 - 15:50 David Berger (Ulm university)

On quasi-infinitely divisible distributions

16:00 - 16:50 佐藤 健一

Reminiscences

17:10 ~ Short Communications

18:30 ~ 懇親会 とりせん 立川本店 <https://torisen-tathikawa.owst.jp/>
多摩都市モノレール 立川北口 徒歩3分 JR 立川駅 徒歩2分
(050-5456-0630 立川市曙町 2-5-17 イノタケビル B1F)

***** 11月9日(土)午前 *****

10:00 - 10:40 山戸 康祐(京大)

Fluctuation scaling limit for jumping-in diffusions with large jumps

10:50 - 11:20 植田 優基(北大)

Fuss-Catalan 分布の自由自己分解可能性 (Freely selfdecomposability for the Fuss-Catalan distributions)

11:30 - 12:10 松井 宗也(南山大)

Asymptotics of maximum likelihood estimation for stable law with continuous parameterization

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。

懇親会について

11月8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：5千円程度

8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7日(木)午後の休憩時及び8日(金)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9日(土)は、警備上の理由で、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。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。