

# ワークショップ 『確率論 早春セミナー』

日時: 2013年3月15日(金) ~ 3月17日(日)

会場: 関西大学第四学舎第四実験棟4A講義室

〒564-8680 大阪府吹田市山手町3丁目3番35号

会場へのアクセス: [http://stoc-proc.com/sympo/2013/4th\\_area.pdf](http://stoc-proc.com/sympo/2013/4th_area.pdf)

## 3月15日(金)

09:40 ~ 10:00 井上 裕貴 (関西大学大学院理工学研究科 M2)

無限分解可能分布と対応する copula について

10:00 ~ 10:20 田中 啓介 (関西大学大学院理工学研究科 M2)

無限級数とランダム級数について

10:20 ~ 10:50 池田 拓哉 (大阪大学大学院理学研究科 M2)

Lasota-Yorke 型不等式をみたす一次元変換に関する混合型中心極限定理について

11:00 ~ 11:50 関根 順 (大阪大学大学院基礎工学研究科) — 特別講演 —

効用最大化に関するサーベイ

13:30 ~ 14:20 永幡 幸生 (新潟大学工学部) — 特別講演 —

流体力学極限について

14:30 ~ 15:10 伊藤 悠 (京都大学大学院情報学研究科 D1)

Integrals along rough paths via fractional calculus

15:20 ~ 15:50 田口 大 (立命館大学大学院理工学研究科 M1)

Euler-Maruyama Approximation for Stochastic Differential Equations with discontinuous drift

15:55 ~ 16:25 大西 勝哉 (関西大学大学院理工学研究科 M2)

非有界な Lévy 測度によって構成されるフェラー半群について

16:30 ~ 17:00 Theodriithi Kirati (大阪大学大学院基礎工学研究科 M2)

Arbitrage Opportunity on Nonlinear Wealth Processes (with Jun Sekine)

## 3月16日(土)

09:40 ~ 10:10 阿部 圭宏 (京都大学大学院理学研究科 M2)

The resistance for the supercritical percolation cluster in a box

10:15 ~ 10:45 川口 照之 (立命館大学大学院理工学研究科 M2)

非可換 Cox-Ross-Rubinstein モデルについて

11:00 ~ 11:50 梶野 直孝 (神戸大学理学部) — 特別講演 —

自己相似フラクタル上の Laplacian の固有値・熱核の漸近挙動

13:30 ~ 14:20 貝瀬 秀裕 (大阪大学大学院基礎工学研究科) — 特別講演 —  
最適制御と動的ゲームにおけるベキ等展開による手法について

14:30 ~ 15:10 永沼 伸顕 (東北大学大学院理学研究科 D1)  
Asymptotic error distributions of the Crank-Nicholson scheme for SDEs driven by fractional Brownian motion

15:20 ~ 15:50 清水 信孝 (立命館大学大学院理工学研究科 M2)  
Asymptotic expansion around affine models

15:55 ~ 16:25 木下 竜二 (関西大学大学院理工学研究科 M2)  
Dirichlet 形式の大域的性質について

16:30 ~ 17:00 近藤 昌也 (大阪大学大学院基礎工学研究科 M2)  
最適消費投資問題における粘性解でのアプローチ

### 3月17日(日)

09:40 ~ 10:10 鈴木 康平 (京都大学大学院理学研究科 M2)  
超距離空間上のマルコフ過程の収束と射影マルコフ性

10:15 ~ 10:45 鈴木 雄介 (立命館大学大学院理工学研究科 M2)  
Simulation results of the soliton property of quadratic Gaussian term structures of interest rate

11:00 ~ 11:50 塩沢 裕一 (岡山大学自然科学研究科) — 特別講演 —  
対称マルコフ過程の大域的性質に関する話題

13:30 ~ 14:10 三浦 佑介 (東北大学大学院理学研究科 D1)  
Ultracontractivity for Markov semigroups and quasi-stationary distributions

14:20 ~ 15:00 天羽 隆史 (立命館大学大学院工学部研究科 D2)  
TBA

15:10 ~ 15:40 森谷 雅史 (大阪大学大学院基礎工学研究科 M2)  
低流動資産に関する対数効用最大化

世話人：永幡 幸生 (新潟大学)  
塩沢 裕一 (岡山大学)  
上村 稔大 (関西大学)