

## 研究集会「確率解析とその周辺」のお知らせ

平成 19 年度科学研究費補助金基盤研究 (A)「確率解析の理論と応用」(研究代表者: 松本裕行), 平成 19 年度科学研究費補助金基盤研究 (B)「無限次元空間における確率解析」(研究代表者: 重川一郎) の援助を受けて, 標記の研究集会を以下の要領で開催致しますのでご案内申し上げます.

日時: 2007 年 11 月 22 日 (木) 13:30 ~ 11 月 24 日 (土) 16:50

場所: 東京工業大学本館 2 階 H213 セミナー室

### プ ロ グ ラ ム

#### 11 月 22 日 (木)

13:30~14:30 矢野 孝次 (神戸大理)

半直線上のマルコフ過程の関数型極限定理

14:40~15:40 田原 喜宏 (東北大理)

非局所型 Feynman-Kac 半群のスペクトル下限の  $L^p$  独立性

15:50~16:50 土田 兼治 (東北大理)

Large deviations for discontinuous additive functionals of symmetric stable processes

17:00~18:00 谷田 篤史 (京大理)

Differentiability of Spectral functions for Non-symmetric Diffusion Processes

#### 11 月 23 日 (金)

自由討論とします

#### 11 月 24 日 (土)

10:00~11:00 齋藤 洋樹 (東京理科大)

Daniell 積分とその応用

11:10~12:10 岩田 友紀子 (北大)

A generalized local limit theorem for mixing semi-flows

— 昼 休 み —

13:30~14:30 針谷 祐 (東北大理)

Integration by parts formulae for Wiener measures restricted to domains in  $\mathbf{R}^d$

14:40~15:40 安田 和弘 (阪大基礎工)

Malliavin-Thalmaier 公式による多次元密度関数の推定とファイナンスへの応用

15:50~16:50 稲浜 譲 (東工大)

A stochastic Taylor-like expansion in the rough path theory

世話人: 重川 一郎 (京大理), 松本 裕行 (名大情報), 会田 茂樹 (阪大基礎工),  
稲浜 譲 (東工大)