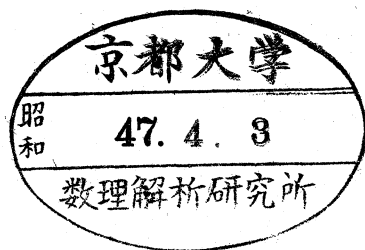


K-510

数理解析研究所講究録 138

Markov 過程



京都大学数理解析研究所

1972年3月

Markov過程シンポジウム報告集

1971年10月11日～10月13日

まえがき

この報告集には「Markov過程シンポジウム」における講演の大部分がおさめられている。Markov過程全般についての研究集会は前年度にも行われ、講究録112がその報告集にあてられている。最近のMarkov過程の研究はその対象が益々多様化しかつ専門化の傾向が著しいので、全体的な研究の方向を把握するために、年に一度位このようにテーマを限定しない研究集会を行うことが今後とも有効であろうと思われる。

研究集会において発表されたこの報告集におさめられていない講演は下記通りである。

田中 洋：弾性球ガスの Boltzmann 方程式の解の存在と一意性

渡辺信三：Diffusion の滑らかな path の近傍の測度に関する公式

小倉幸雄: Continuous state branching process の漸近
的性質について

なお福島正俊氏は「Markov 過程のエルゴード定理
について」という表題で講演されたが、この報告集にお
きめられているのはその前半にあたるポテンシャル論的準備
の部分だけである。^{後半については}上記三氏と同様、いずれ論文として発
表されると思う。

1971年12月

渡辺 教

目次

| | 頁 |
|--------------------------------------|----------|
| 1. 拡散過程の局所構造 | ----- 1 |
| 阪大理 | 池田信行 |
| 京大理 | 渡辺信三 |
| 2. 確率微分方程式の解の安定性 | ----- 11 |
| 名大理 | 宮原孝夫 |
| 3. Jump type の確率積分方程式 | ----- 34 |
| 東工大理 | 土谷正明 |
| 4. Martingale 積分について | ----- 54 |
| 東北大 理 | 風巻紀彦 |
| 5. 確率微分方程式の解の一意的性 条件について (多次元の場合) | ----- 69 |
| 九大工 | 山田俊雄 |
| 京大理 | 渡辺信三 |
| 6. 境界条件をもつ確率微分方程式の解 の一意的性について | ----- 86 |
| 京大理 | 志賀徳造 |
| 神大理 | 中尾慎太郎 |

| | 頁 |
|---|-----------|
| 7. Markov processes in duality | ----- 99 |
| 東教大 理 福島正俊 | |
| 8. Markov過程の分枝性 | ----- 111 |
| 東工大 理 長沢正雄 | |
| 9. Controlled Galton-Watson process について | ---- 118 |
| 東工大 理 藤曲哲郎 | |
| 10. Spitzerの方程式とその random modification | ---- 125 |
| 京大 理 志賀徳造 | |
| 11. 一次元確率微分方程式の解の pathwise uniqueness について | ----- 135 |
| 神大 理 中尾慎太郎 | |