

鹿児島大学数理情報科学談話会

第245回

日時：2025年4月21日（月）16:10 - 17:10

場所：理学部2号館404室

講師：塚田 大史氏 (鹿児島大学)

題目：安定過程により駆動される確率微分方程式の解の一意性について

Abstract: 安定過程とは自己相似性を持つレヴィ過程であり、その指数が2のときはブラウン運動となり、それ以外の場合はジャンプを持つ確率過程となる。ブラウン運動により駆動される確率微分方程式の場合、解の道ごとの一意性を保証する条件や解に関する比較定理がいくつか知られている。本講演では、安定過程で駆動される確率微分方程式について、それらに関する結果を紹介する。

お問合せ：談話会委員 塚田 大史 (✉ tsukada@sci.kagoshima-u.ac.jp ☎ 099-285-8036)

田中 恵理子 (✉ erico@sci.kagoshima-u.ac.jp ☎ 099-285-8988)