

数理解析研究所講究録 932

短期共同研究

確率数値解析に於ける諸問題, II

京都大学数理解析研究所

1995年12月

RIMS *Kokyuroku* 932

2nd Workshop on  
Stochastic Numerics

December, 1995

Research Institute for Mathematical Sciences

Kyoto University, Kyoto, Japan

短期共同研究  
確率数値解析に於ける諸問題, II  
報告集

1995年6月7日~6月9日

研究代表者 小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)

目 次

1.	Stability Analysis of Numerical Solution of Stochastic Differential Equations-----	1
	名大・人間情報                      三井 斌友(Taketomo Mitsui)	
2.	確率微分方程式の数値スキームのT安定性-----	15
	聖徳学園女子短大                      齊藤 善弘(Yoshihiro Saito)	
3.	Stable ROW-Type Weak Scheme for Stochastic Differential Equations---	29
	名大・工                                      小守 良雄(Yoshio Komori)	
	名大・人間情報                      三井 斌友(Taketomo Mitsui)	
4.	Explicit Order 1.5 Runge-Kutta Scheme for Solutions of Itô Stochastic Differential Equations-----	46
	(株)富士通・情報社会科学研                      金児 純司(Junji Kaneko)	
5.	2次元 Josephson 接合格子のLangevin dynamic simulations-----	61
	日立基礎研                                      菅野 量子(Ryoko Sugano)	
6.	GF(2)上のある種の原始多項式の倍数についての予想 - M系列擬似乱数のシミュレーションから - -----	75
	大阪教育大                                      高嶋 恵三(Keizo Takashima)	
7.	GFSR 法による生成列の重み分布の偏りについて-----	82
	工業技術院計量研                      栗田 良春(Yoshiharu Kurita)	
	慶応大・理工                                      松本 眞(Makoto Matsumoto)	
8.	Deterministic Brownian Motions-----	103
	大阪市大・理                                      釜江 哲朗(Teturo Kamae)	
9.	On the notions of randomness-----	118
	京産大・理                                      八杉 満利子(Mariko Yasugi)	
10.	Estimates of Convergence Rates for Approximate Solutions of Stochastic Differential Equations-----	125
	山梨大・教育                                      金川 秀也(Shuya Kanagawa)	

11. 非線形 S D E の数値計算		
— 小川の方法によるシミュレーションについて —	-----	135
日立製作所中央研	直野 健 (Ken Naono)	
12. コルモゴロフ型方程式の数値解析に於けるランダム粒子法の		
ロバストネスについて	-----	142
京都工繊大	小川 重義 (Shigeyoshi Ogawa)	
13. シフト法の評価について	-----	153
九大・数理	杉田 洋 (Hiroshi Sugita)	
14. 退化放物型偏微分方程式の確率解の近似表現	-----	163
城西大・理	天野 一男 (Kazuo Amano)	
15. Donsker のデルタ関数と S D E の離散化による熱核の近似	-----	172
京大・理	渡辺 信三 (Shinzo Watanabe)	
16. 重調和擬過程の境界値問題	-----	177
都立大・理	西岡 國雄 (Kunio Nishioka)	