

2K-5100



数理解析研究所講究録 491

短期共同研究

マルチンゲールとその周辺

禁帯出期間
 58.6.20—6.27
 数研図書室

京都大学数理解析研究所

1983年5月

京都大学

84056704

図書

数理解析研究所

RIMS Kokyuroku 491

RECENT DEVELOPMENT IN MARTINGALE THEORY
AND ITS APPLICATIONS

February, 1983

Research Institute for Mathematical Sciences

Kyoto University, Kyoto, Japan

は し が き

この講究録は、1983年2月に京都大学数理解析研究所において行なわれた短期共同の研究会「マルチンゲールとその周辺」の講演記録です。

確率解析の中核をなすマルチンゲールの理論は、J. L. Doobによる研究(1940)に端を発し、1960年代の後半から著しい成長をとげてきました。今後は、他の分野との交流を一層深めることが大きな課題になるものと思われます。むしろそれが必然の勢いと言えるかもしれません。そこで今回は、特にFourier解析、関数環及び統計の分野との接触を重視し、各分野の研究者のご協力を得て、マルチンゲールとの関連を念頭においた講演及び討論を意欲的に行ないました。研究会としては異例の6日間という長丁場にも関わらず、来日中のA. A. Novikov氏(Steklov Inst.)を含む43名の出席者が、連日熱心に取り組んで下さいましたことを、感謝の気持ちを込めてここに附記しておきます。

研究代表者 風 巻 紀 彦

短期共同研究
マルチンゲールとその周辺

報告集

1983年 2月21日 - 2月26日

研究代表者 風巻 紀彦 Norihiko Kazamaki

目 次

1. Fourier 解析における martingales /
山形大・工 渡利 千波 Chinami Watari
2. Optimal stopping の問題について / 4
愛媛大・教養 森本 宏明 Hiroaki Morimoto
3. 確率論における BMO 25
秋田大・教育 塩田 安信 Yasunobu Shiota
4. 古典的 H^1 と二進的 H^1 の同型定理 (Maurey の理論) 36
茨城大・理 荷見 守助 Morisuke Hasumi
5. Optimal control について 57
東北大・理 和泉沢 正隆 Masataka Izumisawa
6. BMO について 7 /
東北大・教養 内山 明人 Akihito Uchiyama
7. 関数環と martingale 87
早大・理工 新井 仁之 Hitoshi Arai
早大・教育 和田 淳蔵 Junzo Wada

8. Some martingale identities and inequalities / 07
 Steklov Math. Institute, Moscow, A. A. Novikov
9. 逐次分析の問題について / 14
 富山大・経済 高橋 一 Hajime Takahashi
10. 指数マルチンゲールの一様可積分性について / 35
 富山大・理 関口 健 Takeshi Sekiguchi
 富山大・理 風巻 紀彦 Norihiko Kazamaki
11. クライン群のエルゴード性に関する諸予想と Sullivan の
 諸定理 / 39
 京都大・理 谷口 雅彦 Masahiko Taniguchi
12. Martingale における Garnett-Jones の定理と (Ap) 条件 / 58
 富山大・理 風巻 紀彦 Norihiko Kazamaki