



## 目 次

記号と用語について	
第 1 章	加法過程の定義と例
§1.1.	加法過程の定義 ..... 1
§1.2.	特性関数 ..... 7
§1.3.	Poisson 過程 ..... 16
§1.4.	複合 Poisson 過程 ..... 20
§1.5.	Brown 運動 ..... 23
第 2 章	加法過程と無限分解可能分布
§2.1.	無限分解可能分布と法則の意味の加法過程 ..... 32
§2.2.	無限分解可能分布の標準形 ..... 37
§2.3.	推移確率関数と Markov 性 ..... 49
§2.4.	加法過程, Brown 運動の存在 ..... 53
第 3 章	加法過程の生成作用素
§3.1.	線形作用素の半群 ..... 63
§3.2.	推移確率関数から定まる半群 ..... 73
§3.3.	加法過程から定まる半群 ..... 81
第 4 章	安定過程と自己分解可能過程
§4.1.	安定過程, 安定分布と狭義安定過程, 狭義安定分布 ..... 88
§4.2.	安定分布, 狭義安定分布の標準形 ..... 96
§4.3.	自己分解可能過程と L 分布 ..... 107
第 5 章	加法過程の分布の性質
§5.1.	分布の台 ..... 116
§5.2.	劣乗法的関数によるモーメント ..... 123

§5.3.	ある種のモーメントと Lévy 測度の台の大きさ .....	132
§5.4.	分布の連続性と絶対連続性 .....	139
第 6 章	加法過程の Lévy-伊藤分解	
§6.1.	Lévy-伊藤分解の定式化と Poisson 配置 .....	152
§6.2.	Lévy-伊藤分解の証明 .....	155
§6.3.	標本関数の性質 .....	165
第 7 章	再帰的と非再帰的への分類	
§7.1.	強 Markov 性 .....	178
§7.2.	再帰的と非再帰的 .....	185
§7.3.	大数の強法則 .....	193
§7.4.	判定条件とその応用 .....	195
第 8 章	Bochner の従属操作	
§8.1.	線形作用素の半群に対する従属操作 .....	211
§8.2.	加法過程に対する従属操作 .....	221
第 9 章	1 次元加法過程の Wiener-Hopf 分解	
§9.1.	Wiener-Hopf 分解 I .....	234
§9.2.	正の跳びをもたない加法過程の初通過時間過程 .....	248
§9.3.	時刻 0 の近くにおける標本関数の性質 I .....	255
§9.4.	時刻無限大に近づくときの標本関数の性質 I .....	264
§9.5.	Wiener-Hopf 分解 II .....	269
第 10 章	L 分布と Ornstein-Uhlenbeck 型過程	
§10.1.	Ornstein-Uhlenbeck 型過程 .....	288
§10.2.	極限分布としての L 分布 .....	296
§10.3.	1 次元分布の単峰性についての一般論 .....	304
§10.4.	1 次元 L 分布の単峰性となめらかさ .....	317
§10.5.	単峰な分布をもつ 1 次元加法過程 .....	330
第 11 章	諸結果	
§11.1.	時刻 0 の近くにおける標本関数の性質 II .....	336

§11.2. 時刻無限大に近づくときの標本関数の性質 II .....	345
§11.3. 一点への到達確率 .....	348
§11.4. 種々の性質 .....	351
引用文献 .....	358
索引 .....	374