

# 平成 25 年度 RIMS 研究集会 (11 月開催) プログラム

研究 題 目 : 不確実性の下での数理的意思決定の理論と応用

研究 代 表 者 : 金 正道 (弘前大学)

期 間 : 平成 25 年 11 月 11 日 (月), 12 日 (火), 13 日 (水)

場 所 : 京都大学 数理解析研究所 420 号室 (4 階)

## 11 月 11 日 (月)

■■■ 開会の挨拶 (時間: 09:25 ~ 09:30)

セッション 1 (時間: 09:30 ~ 10:00, 10:00 ~ 10:30, 10:30 ~ 11:00)

[1] “ドモアブルが求めた生起継続の確率計算と動的計画法”

岩本 誠一 (九州大学名誉教授), 木村 寛 (秋田県立大学), 安田 正實\* (千葉大学名誉教授)

[2] “ヤングの不等式による動的双対”

岩本誠一 (九州大学名誉教授), 木村寛\* (秋田県立大学), 藤田 敏治 (九州工業大学)

[3] “折り紙ユニットを用いた凸多面体の構成 – 相互依存型決定過程によるアプローチ”

藤田 敏治 (九州工業大学)

セッション 2 (時間: 11:10 ~ 11:40, 11:40 ~ 12:10)

[4] “平均分散モデルの最適解の自己平均性を用いた理論解析”

新里 隆 (秋田県立大学)

[5] “予防保全計画問題に対する不完備情報を考慮したノンパラメトリックブートストラップ法の適用について”

齋藤 靖洋\*, 土肥 正 (広島大学)

■■■ 昼休み (時間: 12:10 ~ 13:30)

セッション 3 (時間: 13:30 ~ 14:00, 14:00 ~ 14:30, 14:30 ~ 15:00)

[6] “オープンソースソリューションの最適メンテナンス時刻推定のための AIR アプリケーションの開発”

足立 翔人\*, 田村 慶信 (山口大学), 山田 茂 (鳥取大学)

[7] “フォールト数の変化を考慮したソフトウェア信頼性モデルにおける最適リリース問題”

大西 健司\*, 北條 仁志 (大阪府立大学)

[8] “離散時間ソフトウェア信頼性モデルに基づいた最適リリース時刻の区間推定に関する一考察”

井上 真二\*, 山田 茂 (鳥取大学)

セッション 4 (時間: 15:10 ~ 15:40, 15:40 ~ 16:10, 16:10 ~ 16:40)

[9] “ファジィ集合の非凸度について”

金 正道 (弘前大学)

[10] “メンバシップ関数設定の柔軟性を考慮したファジィ数理計画問題”

蓮池 隆\* (大阪大学), 片桐 英樹 (広島大学), 椿 広計 (統計数理研究所)

[11] “Construction of infinite product possibility space”

影山 正幸 (名古屋市立大学), 山内 武章, 岩村 覚三\* (城西大学)

## 11 月 12 日 (火)

セッション 5 (時間: 09:30 ~ 10:00, 10:00 ~ 10:30, 10:30 ~ 11:00)

[12] “The resilience effect for the optimal execution problem”

久納 誠矢 (大阪大学)

[13] “Valuation of callable and puttable bonds under the generalized Ho-Lee model: a stochastic game approach”

落合 夏海\*, 大西 匡光 (大阪大学)

[14] “An economics premium principle under the smooth ambiguity aversion”

藤井 陽一朗 (大阪産業大学), 岩城 秀樹\* (京都産業大学), 尾崎 祐介 (大阪産業大学)

セッション 6 (時間: 11:10 ~ 11:40, 11:40 ~ 12:10, 12:10 ~ 12:40)

- [15] “On exact option pricing in the multivariate variance gamma model”  
Roman V. Ivanov (Trapeznikov Institute of Control Sciences of RAS), 穴太 克則\* (芝浦工業大学)
- [16] “Smooth fit conditions on the double stopping boundaries for American put option”  
富田 享平\*, 穴太 克則 (芝浦工業大学)
- [17] “スウィング・オプションにおける評価と行使戦略”  
片貝 和史\*, 穴太 克則 (芝浦工業大学)

■■■ 昼休み (時間: 12:40 ~ 13:40)

セッション 7 (時間: 13:40 ~ 14:10, 14:10 ~ 14:40, 14:40 ~ 15:10)

- [18] “A note on lower bound for multiplicative odds theorem of optimal stopping”  
松井 知己 (東京工業大学), 穴太 克則\* (芝浦工業大学)
- [19] “プロジェクト・リスク・マネジメントにおける遅延時間に関する一考察”  
福田 裕一\*, 桑野 裕昭, 島 孝司 (金沢学院大学)
- [20] “低精度近似モデルを用いた制約なし最適化における勾配ブースティングの効果”  
阪井 節子\* (広島修道大学), 高濱 徹行 (広島市立大学)

セッション 8 (時間: 15:20 ~ 15:50, 15:50 ~ 16:20, 16:20 ~ 16:50)

- [21] “AHP における C.I. の妥当性について”  
田中 浩光 (愛知学院大学)
- [22] “単純な構造をもつネットワーク故障復旧問題について”  
竹下 潤一\* ( (独) 産業技術総合研究所), 毛利 裕昭 (早稲田大学)
- [23] “多状態システムの確率上下界について”  
大鑄 史男 (名古屋工業大学)

## 11月13日(水)

セッション 9 (時間: 09:30 ~ 10:00, 10:00 ~ 10:30, 10:30 ~ 11:00)

- [24] “安定な研究室配属についての一考察”  
長谷川 雅紀\*, 金 正道 (弘前大学)
- [25] “施設警備と防空モデル”  
宝崎 隆祐 (防衛大学校)
- [26] “探索者が初期位置を選ぶことができるようなグラフ上の探索問題”  
菊田 健作 (兵庫県立大学)

セッション 10 (時間: 11:10 ~ 11:40, 11:40 ~ 12:10)

- [27] “大きな提携の提携値が不明な協力ゲームの1点解の選定”  
榎屋 聡\* (大東文化大学), 乾口 雅弘 (大阪大学)
- [28] “協力区間ゲームにおける正規化 Shapley 値”  
鶴見 昌代\*, 久保田 萌美, 乾口 雅弘 (大阪大学)

■■■ 昼休み (時間: 12:10 ~ 13:30)

セッション 11 (時間: 13:30 ~ 14:00, 14:00 ~ 14:30, 14:30 ~ 15:00)

- [29] “多変量ベイズ管理図に対する適応手法”  
佐々木 稔 (日本ピュアテック), 堀口 正之\* (神奈川大学)
- [30] “確率的凸性と部分観測可能なマルコフ決定過程について”  
中井 達 (千葉大学)
- [31] “On the optimal stopping problems with monotone thresholds”  
玉置 光司 (愛知大学)

セッション 12 (時間: 15:10 ~ 15:40, 15:40 ~ 16:10)

- [32] “確率的長方形バリアーでの領域分断を伴う Weber 問題”  
北條 仁志 (大阪府立大学)
- [33] “マーサーの定理とその周辺”

林 芳男 (近畿大学)  
閉会の挨拶 (時間： 16:10 ～ 16:15)