

数理解析研究所講究録 1240

短期共同研究

確率数値解析に於ける諸問題, V

京都大学数理解析研究所

2001年12月

確率数値解析に於ける諸問題, V
 5th Workshop on Stochastic Numerics
 短期共同研究報告集

2001年7月16日~7月19日
 研究代表者 小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)

目 次

1. Independent Component Analysis (ICA) and Method of Estimating Functions-----1	
理化学研	甘利 俊一(Shun-ichi Amari)
2. RECURRENCE SPEED OF TRANSFORMATIONS WITH CONTINUOUS INVARIANT MEASURES-----21	
KAIST	Geon Ho Choe
3. THE FIRST RETURN TIME TEST OF PSEUDORANDOM NUMBERS-----26	
KAIST	Dong Han Kim
4. An application of Malliavin Calculus to Finance-----35	
Univ. Pompeu Fabra	Arturo Kohatsu-Higa
Univ. de Barcelona / Univ. Pompeu Fabra	Miquel Montero
5. An Optimization Algorithm Based On Stochastic Sensitivity Analysis For Noisy Objective Landscapes-----47	
日本IBM・東京基礎研	岡野 裕之(Hiroyuki Okano)
筑波大・社会工学系	香田 正人(Masato Koda)
6. Accelerating Diffusions and Related Problems-----58	
Academia Sinica	Chii-Ruey Hwang
7. Pitman's model of random partitions-----64	
高千穂大	渋谷 政昭(Masaaki Sibuya)
鹿児島大・理	大和 元(Hajime Yamato)
8. Stream Cipher Systems Using a Chaotic Sequence of I.I.D Random Variables-----74	
九大・システム情報科学	香田 徹(Tohru Kohda)
9. On a Synchronization Problem in Asynchronous DS/CDMA System-----88	
九大・システム情報科学	實松 豊(Yutaka Jitsumatsu)
"	香田 徹(Tohru Kohda)
0. 一般化 Niederreiter 列による数値積分の誤差評価-----96	
政策研究大学院大	諸星 穂積(Hozumi Morohosi)
南山大	伏見 正則(Masanori Fushimi)
1. Quasi-random walk methods-----103	
Univ. de Savoie	Christian Lécot

1 2.	The generalized van der Corput sequence and its application to numerical integration-----	114
	一橋大・商	藤田 岳彦(Takahiko Fujita)
	津田塾大	伊藤 俊次(Shunji Ito)
	東工大・理財工学研究センター	二宮 祥一(Syoiti Ninomiya)
1 3.	高次元の low discrepancy sequence の構成-----	125
	日大・文理	森 真(Makoto Mori)
1 4.	フラクタル関数にもとづく予測理論-----	133
	阪市大・理学	釜江 哲朗(Teturo Kamae)
	”	松本 啓一(Keiichi Matsumoto)
1 5.	A limit theorem for sequences generated by Weyl transformations: Disappearance of dependence-----	140
	神大・自然科学	安富 健児(Kenji Yasutomi)
1 6.	On pseudorandom functions-----	152
	神大・理	福山 克司(Katusi Fukuyama)
1 7.	Deviation of pseudorandom numbers and weight test-----	161
	京大・総合人間	松本 眞(Makoto Matsumoto)
	山形大・理	西村 拓士(Takuji Nishimura)
1 8.	Interacting Particle Systems for Random Genetic Drift-----	172
	統数研	伊藤 栄明(Yoshiaki Itoh)
1 9.	長周期非再帰型擬似乱数の並列生成-----	181
	三重大・教育	谷口 礼偉(Hirotake Yaguchi)
2 0.	A Simple Design of Chaotic Binary Sequences with Prescribed Auto-Correlation Properties Based on Piecewise Linear Onto Maps-----	192
	熊大・工	常田 明夫(Akio Tsuneda)
2 1.	Random Number Generation and Dynamical System — Statistical Properties of Binary Sequences Generated by One-dimensional Maps — -----	204
	九大・システム情報科学	大濱 靖匡(Yasutada Oohama)
	”	香田 徹(Tohru Kohda)
2 2.	Statistical Properties of Real-Valued Sequences Generated by Chebyshev maps-----	216
	金沢大・自然科学	藤崎 礼志(Hiroshi Fujisaki)
2 3.	「2 整数が互いに素になる確率」の確率論的見方 — 数値実験による予想の検証 — -----	224
	九大・数理学	杉田 洋(Hiroshi Sugita)
	金沢大・理	高信 敏(Satoshi Takanobu)
2 4.	On the Brownian particle equations and the noncausal stochastic calculus-----	233
	金沢大・自然科学	小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)