

数理解析研究所講究録 1462

RIMS 共同研究

確率数値解析に於ける諸問題, VII

京都大学数理解析研究所

2006年1月

RIMS Kokyuroku 1462

*The 7th Workshop on
Stochastic Numerics*

January, 2006

Research Institute for Mathematical Sciences

Kyoto University, Kyoto, Japan

確率数値解析に於ける諸問題, VII
 The 7th Workshop on Stochastic Numerics
 RIMS 共同研究報告集

2005年6月27日~6月29日
 研究代表者 小川 重義 (Shigeyoshi Ogawa)

目次

1. Filtering volatility from data observed at random time intervals -----	1
Caltech	Jakša Cvitanić
Tel Aviv Univ.	Robert Liptser
Univ. Southern California	Boris Rozovskii
UCLA	Ilya Zaliapin
2. Nonreversible Perturbations Accelerate Convergence -----	26
Academia Sinica, Taipei	Chii-Ruey Hwang
3. Stochastic integral equations of Fredholm type -----	35
立命館大・理工	小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)
4. Entropy representation of optimal logarithmic utility for insiders in Lévy markets ---	46
阪大・基礎工学	Arturo Kohatsu-Higa
琉球大・理	山里 眞(Makoto Yamazato)
5. Random Numbers for Parallel Computations -----	57
南山大・数理情報	伏見 正則(Masanori Fushimi)
6. On the convergence rate of 2-dimensional low discrepancy sequences -----	63
東京工業高专	市川 裕子(Yuko Ichikawa)
日大・文理	森 眞(Makoto Mori)
7. Quantization Methods in Filtering and Applications to Partially Observed Stochastic Volatility Models -----	79
Univ. Paris 7	Huyèn Pham
8. APPLICATION OF STOCHASTIC NUMERICAL METHODS IN MULTI-PERIOD OPTIMAL PORTFOLIO STRATEGIES:CASE STUDIES -----	100
興銀第一ライフ・アセットマネジメント	深谷 竜司(Ryuji Fukaya)
9. PDE approach to utility maximization with partial information -----	116
阪大・基礎工学	長井 英生(Hideo Nagai)
Univ. degli Studi di Padova	Wolfgang J. Runggaldier
10. Comparison of insider's optimal strategies, three different types of side information ---	131
Ecole Polytechnique	Caroline Hillairet
Univ. Paul Sabatier	Monique Pontier

1 1.	A review of recent results on weak approximation of solutions of stochastic differential equations -----	145
	阪大・基礎工学	Arturo Kohatsu-Higa
1 2.	Volatility Smile / Smirk Properties of [GLP & MEMM] Models -----	156
	名古屋市立大・経済学	宮原 孝夫(Yoshio Miyahara)
	"	森脇 成彦(Naruhiko Moriwaki)
1 3.	確率摂動を含む経済成長方程式 -----	171
	中央大・商	西岡 國雄(Kunio Nishioka)
1 4.	Network Investment and Competition with Access-to-Bypass -----	186
	立命館大・経済	堀 敬一(Keiichi Hori)
	関西学院大・商	水野 敬三(Keizo Mizuno)
1 5.	Discrete Itô Formulas and Their Applications to Stochastic Numerics -----	202
	立命館大・理工	赤堀 次郎(Jirô Akahori)
1 6.	A survey on asymptotic evaluations of Wiener functional expectations -----	211
	立命館大・理工	渡辺 信三(Shinzo Watanabe)
1 7.	On the probabilities associated with unitary matrices -----	217
	京大・数理研	高橋 陽一郎(Yoichiro Takahashi)
1 8.	RANSAC を用いた車両運転時のイベント検出法 -----	224
	産総研	佐野 夏樹(Natsuki Sano)
	"	市村 直幸(Naoyuki Ichimura)
	"	栗田 多喜夫(Takio Kurita)
	"	大津 展之(Nobuyuki Otsu)
	筑波大・システム情報工学	鈴木 秀男(Hideo Suzuki)
	"	香田 正人(Masato Koda)
1 9.	Noncausal Stochastic Calculus Revisited -----	231
	立命館大・理工	小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)
*	RIMS 共同研究プログラム -----	254