

数理解析研究所講究録 1548

不確実性を含む意思決定の数理と
その応用

京都大学数理解析研究所

2007年4月

RIMS Kôkyûroku 1548

*Mathematics in a Decision Making
with Uncertainties and Its Applications*

April, 2007

Research Institute for Mathematical Sciences

Kyoto University, Kyoto, Japan

This is a report of research done at Research Institute for Mathematical Sciences, Kyoto University. The papers contained herein are in final form and will not be submitted for publication elsewhere.

1 1.	Real Options Model of R & D -----	77
	京大・情報学(Kyoto U.)	西原 理(Michi Nishihara)
	京大・経済学(Kyoto U.)	大山 篤之(Atsuyuki Ohyama)
1 2.	プログラム規模を考慮した離散ワイブル型ソフトウェア信頼性モデル -----	85
	鳥取大・工(Tottori U.)	井上 真二(Shinji Inoue)
	"	山田 茂(Shigeru Yamada)
1 3.	多時点確率取締ゲームの一段階ゲーム戦略 -----	91
	防衛大学校(Nat. Defense Acad.)	前原 裕樹(Hiroki Maehara)
	"	宝崎 隆祐(Ryusuke Hohzaki)
1 4.	固定費つき複数ナップサック問題の近似解法と厳密解法 -----	99
	防衛大学校(Nat. Defense Acad.)	竹岡 貴裕(Takahiro Takeoka)
	"	山田 武夫(Takeo Yamada)
1 5.	無制約最小化問題に対する拡張 Barzilai-Borwein 法について -----	107
	東京理大・理学(Tokyo U. Sci.)	若松 峻彦(Takahiko Wakamatsu)
	"	成島 康史(Yasushi Narushima)
	東京理大・理(Tokyo U. Sci.)	矢部 博(Hiroshi Yabe)
1 6.	顧客の意思決定を伴う競合的在庫管理問題 -----	115
	大阪府大・理学系(Osaka Prefecture U.)	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
	"	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
1 7.	AHP における一対比較値の緩和な整合性指標について -----	122
	愛知学院大・経営(Aichi Gakuin U.)	田中 浩光(Hiromitsu Tanaka)
1 8.	ある整数資源配分ゲームのシュタッケルベルク均衡 -----	130
	防衛大学校(Nat. Defense Acad.)	宝崎 隆祐(Ryusuke Hohzaki)
	防衛省(Ministry of Defense)	長嶋 真一(Shinichi Nagashima)
1 9.	価値が変動する2人売り出しのノイジー・ゲーム -----	138
	大阪府大・理学系(Osaka Prefecture U.)	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
	"	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
2 0.	Topics from Competitive Game Theory -----	146
		坂口 実(Minoru Sakaguchi)
2 1.	統計的不正アクセス検知モデルの改良 -----	154
	広島大・工学(Hiroshima U.)	林坂 弘一郎(Koichiro Rinsaka)
	"	酒井 悠人(Yuto Sakai)
	"	土肥 正(Tadashi Dohi)
2 2.	多目的緊急施設配置問題に対する対話型ファジィ満足化手法 -----	162
	広島大・工学(Hiroshima U.)	宇野 剛史(Takeshi Uno)
	"	片桐 英樹(Hideki Katagiri)
	"	加藤 浩介(Kosuke Kato)

2 3.	社会的評判を考慮したネットワーク形成に関する エージェントベースシミュレーション分析 -----	170
	広島大・工学(Hiroshima U.)	林田 智弘(Tomohiro Hayashida)
	”	西崎 一郎(Ichiro Nishizaki)
	”	片桐 英樹(Hideki Katagiri)
2 4.	一般化マッチングペニーゲームに関する エージェントベース・シミュレーション分析 -----	178
	広島大・工学(Hiroshima U.)	西崎 一郎(Ichiro Nishizaki)
	”	中倉 剛(Tsuyoshi Nakakura)
	”	林田 智弘(Tomohiro Hayashida)
2 5.	一般均衡理論における超過需要差分方程式の周期点集合に関する 有限被覆最終一様漸近安定性 -----	186
	同志社大・工(Doshisha U.)	齋藤 誠慈(Seiji Saito)
	阪大・情報科学(Osaka U.)	石井 博昭(Hiroaki Ishii)
2 6.	OSS に対するコンポーネントの整合性を考慮した 最適バージョンアップ時期の推定に関する一考察 -----	194
	広島工大・情報(Hiroshima Inst. Tech.)	田村 慶信(Yoshinobu Tamura)
	鳥取大・工(Tottori U.)	山田 茂(Shigeru Yamada)
2 7.	日経 225 オプション市場のボラティリティ・リスク・プレミアム -----	202
	電通大・電子通信学 (U. Electro-Communications)	内田 康嗣(Yasutsugu Uchida)
	”	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
2 8.	日本株式市場局面とインプライドボラティリティの性質 -----	210
	電通大・電子通信学 (U. Electro-Communications)	加藤 明(Akira Kato)
	”	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
2 9.	日経 225 オプションのデルタヘッジに関する一考察 -----	218
	電通大・電気通信学 (U. Electro-Communications)	星加 裕文(Hirofumi Hoshika)
	”	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
3 0.	バリアオプション評価におけるモデルリスク ストキャスティック(SV) vs デタミニスティック(DV) -----	226
	電通大・電気通信 (U. Electro-Communications)	樋野 雅浩(Masahiro Hino)
	”	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
3 1.	2種のサーバーを持つ待ち行列システムでの最適待機政策 -----	234
	鳥取大・工(Tottori U.)	小柳 淳二(Junji Koyanagi)
	鳥取大・工学(Tottori U.)	難波 大輔(Daisuke Nanba)
	鳥取大・工(Tottori U.)	河合 一(Hajime Kawai)