

数理解析研究所講究録 1207

短期共同研究

不確実なモデルによる  
動的計画理論の課題とその展望

京都大学数理解析研究所

2001年5月

不確実なモデルによる動的計画理論の課題とその展望  
 Perspective and problem for Dynamic Programming with uncertainty  
 短期共同研究報告集

2001年2月5日～2月7日

研究代表者 安田 正實(Masami Yasuda)

副代表者 中神 潤一(Jun-ichi Nakagami)

目 次

1.	離散時間の信用リスクのある割引債券モデル-----	1
	九大・経済学	宮本 正和(Masakazu Miyamoto)
	九大・経済学	中井 達(Toru Nakai)
2.	不確実性下における需要処理配分問題-----	22
	関西大・情報処理センター	北尾 匡史(Masachika Kitao)
	阪府大・総合科学	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
	関西大・総合情報	仲川 勇二(Yuji Nakagawa)
	阪府大・総合科学	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
3.	多期間在庫モデルについての研究-----	33
	阪府大・総合科学	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
	阪府大・総合科学	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
4.	Stopped Markov Decision Processes with Multiple Constraints-----	41
	千葉大・自然科学	堀口 正之(Masayuki Horiguchi)
5.	集合値写像のスカラー化とKy Fan の不等式-----	55
	新潟大・自然科学	西澤 正悟(Shogo Nishizawa)
	Univ. of Sofia	Pando Gr. Georgiev
	新潟大・自然科学	田中 環(Tamaki Tanaka)
6.	集合値写像の凸性の遺伝性について-----	67
	新潟大・自然科学	西澤 正悟(Shogo Nishizawa)
	新潟大・自然科学	田中 環(Tamaki Tanaka)
	Univ. of Sofia	Pando Gr. Georgiev
7.	確率最適化における過去集積値と未来閾値について-----	79
	九大・経済学	植野 貴之(Takayuki Ueno)
	九大・経済学	岩本 誠一(Seiichi Iwamoto)
8.	最大値過程について-----	101
	九大・経済学	岩本 誠一(Seiichi Iwamoto)
	九大・経済学	津留崎 和義(Kazuyoshi Tsurusaki)

9. A Search Game on a Cyclic Graph-----			114
	神戸商科大	菊田 健作(Kensaku Kikuta)	
10. 選好空間を構成せずに議案行動より直接計算する			
非対称 Banzhaf 指数の一考察-----			128
	南山大・経営学	遠藤 理世(Riyo Endo)	
	南山大・経営学	鈴木 貴(Takashi Suzuki)	
	南山大・経営	穴太 克則(Katsunori Ano)	
11. アメリカンオプションの最適行使境界の数値計算解法について-----			136
	南山大・経営学	鈴木 淳生(Atsuo Suzuki)	
	南山大・経営学	瀬古 進(Susumu Seko)	
	南山大・経営	穴太 克則(Katsunori Ano)	
12. 偏差行列とマルコフ決定過程の精密割引最適化基準へのその応用-----			147
	和歌山大・教育	門田 良信(Yoshinobu Kadota)	
13. On a Fuzzy Extension of Stopping Times-----			157
	北九州市立大・経済	吉田 祐治(Yuji Yoshida)	
	千葉大・理	安田 正實(Masami Yasuda)	
	千葉大・理	中神 潤一(Jun-ichi Nakagami)	
	千葉大・教育	蔵野 正美(Masami Kurano)	
14. Markov decision processes with fuzzy rewards-----			165
	千葉大・教育	蔵野 正美(Masami Kurano)	
	千葉大・理	安田 正實(Masami Yasuda)	
	千葉大・理	中神 潤一(Jun-ichi Nakagami)	
	北九州市立大・経済	吉田 祐治(Yuji Yoshida)	