

## 平成 27 年度 RIMS 研究集会プログラム



### 不確実・不確定性の下での数理意思決定モデルとその周辺

研究代表者：丸山幸宏（長崎大学）

期間：平成27年11月11日(水)～13日(金)

場所：京都大学理学部数学教室110 号室

#### 11 月 11 日 (水)

■■■ 開会の挨拶 (時間：8:55 ～ 9:00)

セッション1 (時間：9:00 ～ 9:30, 9:30 ～ 10:00, 10:00 ～ 10:30, 10:30～11:00)

- [1] 経験曲線効果を考慮した新製品とリサイクル製品の在庫管理  
是枝友樹\*, 北條仁志 (大阪府立大学)
- [2] 小売企業における供給不確実性を伴う競争分析  
岡田拓也\*, 北條仁志 (大阪府立大学)
- [3] 区間AHPにおけるいくつかの区間優先度の推定法とそれらの比較  
印南 成章\*, 乾口 雅弘(大阪大学)
- [4] Interval UTA method for multiple criteria decision aiding  
乾口 雅弘\* (大阪大学), Roman Slowinski (ボズナン工科大学), Salvatore Greco (カターニア大学)

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

- [5] 一般化 Ho-Lee モデルのもとでのゲーム・スワップシヨンの価格評価  
蛭名安希\*, 落合夏海, 大西匡光 (大阪大学)
- [6] 修理系システムに対する統計的ノンパラメトリック推論に関する一考察  
齋藤靖洋\*, 土肥正 (広島大学)
- [7] 一般の不完備情報協力ゲームとそのShapley値  
梶屋聡 (大東文化大学)

■■■ 昼休み (時間：12:40 ～ 14:00)

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

- [8] ロバスト性とファジィ推論による期待利益設定を統合した二目的ポートフォリオ選択問題  
蓮池 隆 (早稲田大学)
- [9] セミフィボナッチ制約下の2次最適化 (I)  
岩本誠一 (九州大学名誉教授), 木村寛\* (秋田県立大学)

[10] Fractional analysis method of time series data

大鑄史男 (名古屋工業大学)

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

- [11] マルコフ決定過程におけるベイズ管理モデルについて  
堀口正之 (神奈川大学)
- [12] On a decision process with portfolios for value-at-risks  
吉田祐治(北九州市立大学)

#### 11 月 12 日 (木)

セッション5 (時間：9:00 ～ 9:30, 9:30 ～ 10:00, 10:00 ～ 10:30, 10:30 ～ 11:00)

- [13] Optimal strategy to get a Free Agent batter by optimal batting order model on Markov chain  
高野 健大\*, 穴太克則 (芝浦工業大学)

[14] Multilevel Monte Carlo Simulation for American Option on Jump Diffusion Process

住本 賢吾\*, 穴太克則(芝浦工業大学)

[15] Lundberg model of the ruin probability for insurance company with asset management

大内康裕\*, 穴太克則 (芝浦工業大学)

[16] Multiple Stopping for American Put Option on Geometric Random Walk

大石潤\*, 穴太克則 (芝浦工業大学)

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

- [17] Gilesのマルチレベル・モンテカルロ法を包含するフレームワークによる  
オプション・プライシングと複数種類のマルチレベル推定量の探究  
乾仁\*(早稲田大学), 穴太克則 (芝浦工業大学)

**[18] Optimal stopping strategy for Odds problem with uniformly distributed number of items**

来島愛子\*(上智大学), 穴太克則 (芝浦工業大学)

**[19] 転換社債価格評価への改良LCTアプローチ**

木村 俊一, 米盛逸人\* (関西大学)

■■■ 昼休み (時間: 12:40 ~ 14:00)

セッション7 (時間: 14:00 ~ 14:30, 14:30 ~ 15:00, 15:00 ~ 15:30)

**[20] レーティングシステムを利用した差分進化によるコンピュータオセロプレイヤーの学習**

阪井節子\* (広島修道大学), 高濱徹行 (広島市立大学)

**[21] 侵入経路を考慮した警備ゲーム**

宝崎隆祐\*, 酒井吟次郎 (防衛大学校)

**[22] HiderがScreening能力を持つ探索ゲーム**

Andrey Garnaev(Saint Petersburg State University), 菊田健作\* (兵庫県立大学)

セッション8 (時間: 15:40 ~ 16:10, 16:10 ~ 16:40)

**[23] 複数のL<sup>(h)</sup>凸集合に対する離散分離定理**

川崎英文 (九州大学)

**[24] Urn sampling distributions giving alternate correspondences between two optimal stopping problems**

玉置光司 (愛知大学)

11月13日(金)

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

**[25] 集団混合問題における構造的性質について**

小笠原悠\*, 金正道 (弘前大学)

**[26] モバイルクラウドに対する最適データ分割を考慮したソフトウェアの最適メンテナンス問題**

田村慶信\*(山口大学), 信川ゆみ(鳥取大学), 山田茂 (鳥取大学)

**[27] 多属性効用理論に基づいた最適リリース時刻およびチェンジポイントの推定に関する研究**

南野友香\* (鳥取大学), 井上真二(鳥取大学), 山田茂 (鳥取大学)

**[28] ロジスティック回帰に基づくテスト環境要因を考慮したソフトウェア信頼性評価に関する一考察**

井上真二\*, 山田茂 (鳥取大学)

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

**[29] 相互依存型決定過程 – 1ステージモデル–**

藤田敏治 (九州工業大学)

**[30] 7つの双対問題**

植野貴之\*(長崎県立大学), 木村寛 (秋田県立大学), 岩本誠一 (九州大学名誉教授)

**[31] 決定回数が未知の多段決定問題について**

中井達 (千葉大学)

■■■ 昼休み (時間: 12:40 ~ 14:00)

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

**[32] プロジェクト・リスク・マネジメントにおけるリスク対策の数理モデル化**

福田裕一\*, 桑野裕昭 (金沢学院大学)

**[33] Zadeh の拡張原理に関する一考察**

金正道\*(弘前大学)

**[34] On the effect of variance-stabilizing transformation to wavelet-based software reliability assessment**

肖霄 (首都大学東京)

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

**[35] AHPにおける一対比較値行列(4×4)の整合性指標について**

田中浩光 (愛知学院大学)

**[36] 正単調非決定性逐次決定過程における超表現定理について**

丸山幸宏 (長崎大学)

■■■ 閉会の挨拶 (時間: 16:40 ~ 16:45)