

数理解析研究所講究録 1306

不確実性の下での意思決定の数理

京都大学数理解析研究所

2003年2月

不確実性の下での意思決定の数理
Mathematics of Decision-making under uncertainty
研究集会報告集

2002年11月13日～11月15日
研究代表者 玉置 光司(Mitsushi Tamaki)

目 次

1.	Optimal stopping problem with reservation where the reserving cost for the recalled offer returns -----	1
	愛知大・経営 齋藤 毅(Tsuyoshi Saito)	
2.	ポアソン到着を伴う所有期間最大化最適停止問題について -----	11
	東大・総合文化 来島 愛子(Aiko Kurushima)	
	南山大・経営 穴太 克則(Katsunori Ano)	
3.	不確実な状況下での発電機起動停止問題 -----	18
	(財) 電力中央研 椎名 孝之(Takayuki Shiina)	
4.	Game Theoretic Analysis of a Stochastic Inventory Control Problem -----	28
	神戸商大・商経 菊田 健作(Kensaku Kikuta)	
5.	BEST-CHOICE GAMES WHERE ARBITRATION COMES IN -----	34
	阪大・名誉教授 坂口 実(Minoru Sakaguchi)	
6.	A Fuzzy Stopping Problem with the Concept of Perception -----	40
	千葉大・教育 蔵野 正美(Masami Kurano)	
	千葉大・理 安田 正實(Masami Yasuda)	
	" 中神 潤一(Jun-ichi Nakagami)	
	北九州大・経済 吉田 祐治(Yuji Yoshida)	
7.	On Convex Fuzzy Games -----	47
	Alexandru Ioan Cuza Univ. Rodica Brânzei	
	Tilburg Univ. Stef Tijs	
8.	確率過程を考慮したネットワークデザインゲームについて -----	57
	早大・商 毛利 裕昭(Hiroaki Mohri)	
9.	Valuing Convertible Bonds with Reset Clauses via Monte Carlo Simulation -----	63
	北大・経済学 木村 俊一(Toshikazu Kimura)	
	北大・工学 篠原 敏夫(Toshio Shinohara)	
10.	ニューロ DP による生産ラインの最適制御 -----	73
	名工大 大野 勝久(Katsuhisa Ohno)	
11.	目標集合を持つ非割引マルコフ決定過程における最適閾値確率 -----	83
	高知大・理 大坪 義夫(Yoshio Ohtsubo)	

1 2.	部分観測可能なマルコフ連鎖におけるジョブ・サーチについて -----	91
	九大・経済学	中井 達(Tōru Nakai)
1 3.	マルコフ決定過程に対する Q-learning について -----	101
	徳島大・総合科学	大橋 守(Mamoru Ohashi)
1 4.	無限個の制約条件を有する最適化問題について — ファジィ微分方程式への応用 — -----	109
	阪大・情報科学	齋藤 誠慈(Seiji Saito)
	"	石井 博昭(Hiroaki Ishii)
1 5.	Variational Inequality Problems for Monotone Mappings -----	118
	東工大・情報理工学	豊田 昌史(Masashi Toyoda)
1 6.	品質低下と不足を考慮した在庫補充問題について -----	125
	阪府大・総合科学	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
	"	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
1 7.	一般分布に従う要求処理配分問題 -----	133
	阪府大・総合科学	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
	"	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
1 8.	基本セルオートマトンが生成する時空間パターン — Sierpinski Gasket — ----	142
	名工大	大鱗 史男(Fumio Ohi)
1 9.	Estimating Discrete-Time Periodic Software Rejuvenation Schedules under Cost Effectiveness Criterion -----	152
	広島大・工学	岩本 一樹(Kazuki Iwamoto)
	"	土肥 正(Tadashi Dohi)
	広島修道大・経済科学	海生 直人(Naoto Kaio)
2 0.	Location Game with Degressive Weighted Voronoi Region -----	162
	神戸芸工大	大角 盛広(Shigehiro Osumi)
	神戸学院大・経済	塩出 省吾(Shogo Shiode)
2 1.	不確定環境型遺伝的アルゴリズムとウェーブレット変換による リモートセンシング画像圧縮最適化 -----	172
	京都府大・人間環境	吉富 康成(Yasunari Yoshitomi)
	日立公共システムエンジニアリング (株)	甲斐 康士(Kouji Kai)
	宮崎大・工	田伏 正佳(Masayoshi Tabuse)
2 2.	学習グループ編成における意思決定 -----	178
	岡山理大・情報処理センター	岩崎 彰典(Akinori Iwasaki)
	岡山理大・総合情報	宮地 功(Isao Miyaji)
	"	尾上 誉幸(Takayuki Oue)

2 3.	金融時系列の独立成分によるパターンの認識と特徴点抽出 (人工市場モデルにおいて生成された金融時系列への適用に関する一考察) ---	186
	広島県立大・経営	奥原 浩之 (Koji Okuhara)
	広島大・工学	柴田 淳子 (Junko Shibata)
	広島県立大・経営	泉本 圭介 (Keisuke Izumoto)
	〃	田中 稔次郎 (Toshijiro Tanaka)
2 4.	Dynamic Asset Allocation under Uncertainty -----	191
	阪大・経済学 / 京大・経済学	大西 匡光 (Masamitsu Ohnishi)
	阪大・経済学	丹波 靖博 (Yasuhiro Tamba)
2 5.	Maximizing Order Probabilities on Controlled Markov Chains -----	201
	長崎県立大・経済	植野 貴之 (Takayuki Ueno)
	九大・経済学	岩本 誠一 (Seiichi Iwamoto)
2 6.	動的計画論における決定ツリーと政策 -----	210
	九工大・工	藤田 敏治 (Toshiharu Fujita)
2 7.	AN EXPLICIT FORMULA FOR THE LIMITING OPTIMAL GAIN IN THE FULL INFORMATION DURATION PROBLEM -----	217
	Karelian Research Center	Vladimir Mazalov
	愛知大・経営	玉置 光司 (Mitsushi Tamaki)
2 8.	応募者数が一般化された一様分布の下での Gusein-Zade 問題 -----	223
	愛知大・経営	川合 益代 (Masuyo Kawai)
	〃	玉置 光司 (Mitsushi Tamaki)