

数理解析研究所講究録 1351

短期共同研究

確率数値解析に於ける諸問題, VI

京都大学数理解析研究所

2004年1月

確率数値解析に於ける諸問題, VI  
6th Workshop on Stochastic Numerics  
短期共同研究報告集

2003年7月14日~7月16日  
研究代表者 小川 重義 (Shigeyoshi Ogawa)

目次

1. Multidimensional Brownian local times in the Malliavin calculus -----	1
金沢大・自然科学	高信 敏(Satoshi Takanobu)
2. Weyl 変換に関する従属性消滅定理とマルコフ連鎖 -----	25
神戸大・自然科学	安富 健児(Kenji Yasutomi)
3. 疑似乱数生成器の安全性とモンテカルロ法 -----	33
阪大・理	杉田 洋(Hiroshi Sugita)
4. 間隙級数の一様型重複対数の法則について -----	41
神戸大・理	福山 克司(Katusi Fukuyama)
5. Term Structure Modelling and Monetary Policy -----	49
日本銀行	吉田 敏弘(Toshihiro Yoshida)
6. On the asymptotic analysis of discrete-time queues -----	63
南山大・数理情報	石崎 文雄(Fumio Ishizaki)
7. 疑似乱数検証ツールの調査開発 -----	80
東芝ソリューション (株)	
SI 技術開発センター	丹羽 朗人(Akito Niwa)
"	枡窪 孝也(Kouya Tochikubo)
8. The numerical criterion on pseudo random numbers -----	94
都立大・理	下山 由貴子(Yukiko Shimoyama)
9. グラフの連結安定性の評価へのモンテカルロ法の応用 -----	99
政策研究大学院大	諸星 穂積(Hozumi Morohosi)
"	大山 達雄(Tatsuo Oyama)
10. A Robust Boosting Method using Zero-one Loss Function : SNRBoost -----	106
筑波大・社会工学	佐野 夏樹(Natsuki Sano)
筑波大・社会工学系	鈴木 秀男(Hideo Suzuki)
"	香田 正人(Masato Koda)
11. Mining Association Rules using Lattice Theory -----	122
筑波大・社会工学系	Florent Domenach
"	香田 正人(Masato Koda)
12. 計数問題における複合モンテカルロ法について -----	134
金沢大・自然科学	中村 将人(Masato Nakamura)
立命館大・理工	小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)

1 3.	重調和擬過程の境界値問題とその数値シミュレーション — 問題の起源と確率論からのアプローチ —	-----	143
	都立大・理	西岡 國雄(Kunio Nishioka)	
1 4.	Biharmonic Operator を含む非線形問題のシミュレーション	-----	155
	東京電機大・理工学	岩渕 匠(Takumi Iwabuchi)	
	〃	佐藤 定夫(Sadao Sato)	
1 5.	On Identification via Channels	-----	169
	九大・システム情報科学	大濱 靖匡(Yasutada Oohama)	
1 6.	[Geometric Lévy Process & MEMM] 価格理論モデルについて	-----	181
	名古屋市立大・経済学	宮原 孝夫(Yoshio Miyahara)	
1 7.	Numeration systems, fractals and stochastic processes	-----	189
	大阪市立大・理学	釜江 哲朗(Teturo Kamae)	
1 8.	Generalized van der Corput Sequences and Dynamical Systems	-----	201
	金沢大・工	伊藤 俊次(Shunji Ito)	
1 9.	A NEW SIMULATION METHOD OF DIFFUSION PROCESSES APPLIED TO FINANCE	-----	217
	東大・数理科学	楠岡 成雄(Shigeo Kusuoka)	
	東工大・理財工学研究センター	二宮 祥一(Syoiti Ninomiya)	
2 0.	Noncausal Cauchy problem for the noncausal SDEs	-----	229
	立命館大・理工	小川 重義(Shigeyoshi Ogawa)	
*	短期共同プログラム	-----	244