



研究部会報告

● システム最適化の理論と応用 ●

・第17回

日時：7月7日(土) 14:00~17:00

出席者：15名

場所：九州大学経済学部 2階中会議室

テーマと講師：

(1)「日本株式市場における株価収益率分布とニュースの関係」

森保 洋 (長崎大学経済学部)

これまでの研究で、株価の収益率分布は条件付き正規分布に従うことが予想されている。条件付き分散は市場に流入するニュースの量の関数であるとする仮説である。この報告では実際に日本の証券市場におけるデータを用いた検証を行い、ニュースありとニュースなしのモデルで有意な差が見られ、本報告の有効性が確認された。

(2)「データ分析のためのデータ分類昨日」

古川哲也 (九州大学大学院経済学研究院)

データベースを構成する場合、あらかじめ分析した結果を検索作業に生かすことができれば効率が上昇する。ここでは、分類階層に基づくデータ分類の方法を提案している。最初に階層生成のための代数的な条件と定理について整理し、次に階層の完全性と単純性について述べ、独立した階層による表現を用いることを提案している。

● OR における数理システムの最適化 ●

・第7回

日時：7月20日(金)

出席者：20名

場所：富山県民会館 501号室

テーマ：「インターネットにおけるコンテンツ配信技術の最新動向」

講師：中川郁夫 (インテック・ウェブ・アンド・インフォマティクス技術部)

インターネットではウェブや映像などのコンテンツをユーザに効率的に送り届ける技術として、コンテンツ配信技術が注目を集めている。これはコンテンツ同期とリクエストの誘導によって実現される。本発表では、これらの技術の最新動向について報告し、現在のコンテンツ配信上の最適化アルゴリズムについても言及する。

● ゲーム理論とその応用 ●

・第13回

日時：8月6日(月)

出席者：20名

場所：東京工業大学大岡山キャンパス西4号館302号室

テーマ：「A Noncooperative Bargaining Foundation of Nucleolus—The Nucleolus Equivalence」

講師：渡邊直樹 (Department of Economics, SUNY at Stony Brook and Kyoto University)

協力ゲームの1つの解である \bar{v} (nucleolus) を非協力交渉ゲームから導く試みに対する最近の研究成果が報告された。必ずしも \bar{v} を導かない場合があること、コアが空であるときには交渉ゲームにおいて均衡が存在しない場合があることなどが議論され、これまでにない新しい交渉ゲームのアイデアの提示があった。

・第14回

日時：9月8日(土)

出席者：25名

場所：東京工業大学大岡山キャンパス西4号館 W 461 講義室

テーマ：「ネット指向戦略シナリオ・プランニング手法とゲーム理論：金融工学の視点から」

講師：内平直志 (東芝研究開発センター システム技術ラボラトリー)

不確実(リスク)要因を含むビジネス・プロジェクトや研究開発プロジェクトの評価について、戦略シナリオをペトリネットで記述し、正味現在価値を算出する方法の提案があった。ペトリネットによる記述とゲーム理論の展開形表現との関連、さらには金融工学分野へのゲーム理論的思考の導入について、活発な議論が行われた。