

統数研共同研究集会「経済物理学とその周辺」H24 年度第一回研究会

日 時: 8月27日(月) 10:00~17:20 (17:20~懇親会)

8月28日(火) 10:00~15:00

場 所: キヤングローバル戦略研究所 会議室3

東京都千代田区丸の内1-5-1 新丸ビル11階

開催者: 統計数理研究所・キャンングローバル戦略研究所 共同開催

■8月27日(月)

10:00--10:10 挨拶 福井俊彦 (キャンングローバル戦略研究所 理事長)

10:10--11:50 Session 1 Chair: 水野貴之
(筑波大学大学院システム情報工学研究科, CIGS)

「ネットワークモチーフが明らかにする企業間の取引関係」
大西立顕 (CIGS, 東京大学大学院経済学研究科), 高安秀樹 (ソニーCSL),
高安美佐子 (東京工業大学大学院総合理工学研究科)

「一国規模の企業取引ネットワークと企業の売上」
渡邊隼史 (ホットリンク), 高安秀樹 (ソニーCSL), 高安美佐子(東工大)

「資産の市場価格と銀行システムの不安定性」
前野義晴 (日本電気株式会社)

「コブ・ダグラス型生産関数とジブラ則」
藤本祥二 (金沢学院大学経営情報学部, CIGS)

11:50--12:50 <昼食・休憩>

12:50--14:30 Session 2 Chair: 大西立顕 (CIGS, 東大)

「e-店舗の異質性とオンライン市場の値崩れの関係」
水野貴之 (筑波大学大学院システム情報工学研究科, CIGS)

「所得分布と相互作用の効果について」
荒田禎之 (東京大学大学院経済学研究科)

「乱数度器 RMT-テストの実データへの応用～ハッシュ値と先物 Tick 株価～」
楊欣 (鳥取大学大学院工学研究科情報エレクトロニクス専攻)

「RMT 利用による東証4半期毎の主成分追跡～業種分類の再考で見えるもの～」
田中美栄子 (鳥取大学大学院工学研究科), 山本敦史 (鳥取大学大学院工学研究科)

14:30—14:50 <休憩>

14:50—16:30 Session 3 Chair: 藤本祥二 (金沢学院大, CIGS)

「Hi-net 地震時系列データの異時刻相関解析」
新井優太(新潟大学大学院自然科学研究科)

「Finance model と Multifractal random walk」
黒田耕嗣 (日本大学大学院総合基礎科学研究科)

「複数の為替レートのパターン・エントロピーによる分析」
石崎龍二 (福岡県立大学人間社会学部)

「外国為替市場における参加者行動の網羅的計量」
佐藤彰洋 (京都大学大学院情報学研究科)

17:00— 懇親会 ※希望者のみ

■8月28日(火)

10:00—11:15 Session 4 Chair: 水野貴之 (筑波大, CIGS)

「進化型 IPD を用いた最適戦略の探索」
糸井良太 (鳥取大学大学院工学研究科情報エレクトロニクス専攻)

「研究分野“知”図とその可視化」
藤田裕二 (日本大学理工学研究所, (株)ターンスターンリサーチ)

「Collective behavior of stock prices as a precursor to market crash」
増川純一 (成城大学経済学部)

11:15—11:55 「景気循環の結合振動子モデル」
池田裕一(京都大学リーディング大学院思修館)

11:55—12:40 <昼食・休憩>

12:40—13:20 「 Reconstruction Macroeconomics 」
吉川洋 (東京大学大学院経済学研究科)

13:20—15:00 Session 5 Chair: 大西立顕 (CIGS, 東大)

「株式市場における隠れたフラストレーション構造」
家富洋(東京大学大学院経済学研究科),
吉川丈夫 (新潟大学大学院自然科学研究科), 飯野隆史(新潟大学理学部)

「企業間取引ネットワークにおけるシステミックリスクの計測」
間真実 (一橋大学大学院経済学研究科)

「RMT テストの性能検証～NIST 乱数検定との比較～」
三賀森悠大（鳥取大学大学院工学研究科情報エレクトロニクス専攻）

「再構成可能コンピューティング
:FPGA におけるマルチエージェントシミュレーションのハードウェア化」
ザパート・クリストファー（統計数理研究所データ同化開発センター）

15:00 閉会

以 上