



研究部会報告

○ AHP の理論と実際 ○

・第13回

日時：9月24日(火) 14:00~17:00

出席者：10名

場所：勸電力中央研究所大手町第1会議室
千代田区大手町1-6-1 大手町ビル7階733室

テーマと講師：

(1)「防災まちづくりにおける住民との合意形成手法」

石井儀光 (国土交通省)

防災まちづくりを実施する上で、住民との合意形成を図る手段として AHP の活用を提案した。シミュレーションを用いて火災の危険性と被害状況、避難困難性などを提示し、住民の意見を採り入れるために AHP による定性的評価を行う。初期段階から住民意見を採り入れたまちづくりプランの策定に役立てようとの提案であった。

(2)「人事領域における AHP 適用事例」

佐藤正史 (㈱日立製作所)

新しい人事評価制度に AHP が活用できるのではないかと発表であった。事例では4名の部下が3名の上司を評価した。評価基準としては、定量評価として実績、定性評価として能力・人格をあげている。定量評価については、数量の指数化をはかり、定性評価の能力については5段階評価(絶対評価)を用いた。

○ 金融工学 ○

日時：9月27日(金) 19:00~20:50

出席者：17名

場所：早稲田大学西早稲田キャンパス

テーマと講師：

(1)「公的年金への多期間最適化モデルの適用」

枇々木規雄 (慶應義塾大学), 茶野 努 (住友生命

総合研究所)

公的年金の基本ポートフォリオ策定に関して、預託金の償還期限の7年で基本ポートフォリオを実現することの効率性、分析開始時のポートフォリオが考慮されていない点、分析期間のキャッシュフローの変化が反映されないことの3つの問題点を指摘し、基本ポートフォリオを多期間モデルの枠組みを用いて分析した。(2)「動的オプションヘッジのバリューアットリスク推定」

山田雄二 (筑波大学)

オプションのデルタヘッジを行った場合、ヘッジ誤差から生じるリスクについての VaR を以下の手順で推定する方法を示した。デルタヘッジは二乗平均最適ヘッジの特殊解であることを利用して、二乗平均最適ヘッジのヘッジ誤差の任意字数に関するモーメントを求めた上で、凸最適化バウンドを組み合わせて VaR を推定した。

○ COM・APS (先進的スケジューリング) ○

・第15回

日時：9月30日(月) 18:00~21:00

出席者：14名

場所：青山学院大学青山キャンパス 総研ビル9階第16会議室

テーマと講師：「GERM によるスケジューリング問題記述の特徴と応用—ある APS システムの問題記述を例として」

関口恭毅 (北海道大学), 鮎 金源 (札幌オフィスコンピューター株式会社), 向原 強 (北海道情報大学)

スケジューリングに関する意思決定支援を意識した問題の記述法である GERM を紹介した。具体的には、ある問題例を GERM によってどのように記述するかを、オブジェクト指向の影響を受けた「型」の種類を説明しつつ明らかにした。GERM、問題の定義、問題を解く際のソルバーの選択などにメリットをもたらす。