

日本オペレーションズ・リサーチ学会北海道支部

平成 28 年度 支部総会、第1回運営委員会

日時:平成 28 年 4 月 8 日(金) 18:00~19:00

場所:小樽商大札幌サテライト 小講義室 (札幌市中央区北 5 条西 5 丁目 7 番地)

次第

1. 開会の辞
2. 資格審査
3. 支部長挨拶
4. 議題
 - (1)平成 27 年度事業報告
 - (2)平成 27 年度収支決算報告ならびに監査報告
 - (3)平成 28 年度役員(案)
 - (4)平成 28 年度事業計画(案)
 - (5)平成 28 年度予算(案)
 - (6)その他
5. 閉会の辞

議題

(1)平成 27 年度事業報告

1. 通常総会

日時:平成 27 年 4 月 14 日(火) 18:30~19:00

場所:小樽商大札幌サテライト 小講義室 (札幌市中央区北 5 条西 5 丁目 7 番地)

議題:

- (1) 平成 26 年度事業報告
- (2) 平成 26 年度収支決算報告ならびに監査報告
- (3) 平成 27 年度事業計画(案)
- (4) 平成 27 年度予算(案)
- (5) 平成 27 年度役員(案)
- (6) その他

2. 運営委員会

日時:平成 27 年 4 月 14 日 18:00~18:30

場所:小樽商大札幌サテライト 小講義室 (札幌市中央区北 5 条西 5 丁目 7 番地)

議題:

- (1) 平成 26 年度事業報告
- (2) 平成 26 年度収支決算報告ならびに監査報告
- (3) 平成 27 年度事業計画(案)
- (4) 平成 27 年度予算(案)
- (5) 平成 27 年度役員(案)
- (6) その他

3. 講演会

(1) 第1回講演会

日時:平成 28 年 2 月 22 日(月) 18:00~20:00

場所:小樽商大札幌サテライト 中講義室 (札幌市中央区北 5 条西 5 丁目 7 番地)

講演 1

テーマ:劣モジュラ最適化と機械学習 ~理論と計算~

講師:永野清仁 氏(公立ほこだて未来大学)

概要:機械学習はコンピュータに人間のような学習能力を獲得させるための技術です。ビッグデータ活用の必要性和相まって、機械学習の重要性は広く認識されつつあります。最適化技術に基づく手法は現在、機械学習分野の標準的なアプローチです。今回は、近年注目されている機械学習のための劣モジュラ最適化について、河原吉伸氏(大阪大学)と共著の書籍「劣モジュラ最適化と機械学習」(講談社、2015 年 12 月)の内容や最新の話題について解説された。

講演 2

テーマ:交通・観光ビッグデータがもたらす変革

講師:野津直樹 氏(株式会社ナビタイムジャパン)

概要:カーナビや乗換検索といったナビゲーションサービスは、今や交通インフラの一翼と言えるほど普及しています。月間 3000 万人のユニークユーザを誇るナビタイムジャパンでは、そうしたサービスの利用実績が大量に蓄積されるようになりました。講演では、自動車の渋滞対策、イベント時の突発的移動需要予測、公共交通の最適化、観光施設の集客、訪日外国人の回遊など、交通・観光ビッグデータの幅広い分析事例を紹介すると共に、ビッグデータが交通・観光分野にもたらす変革について解説が行われた。

4. 研究会

(1) 北海道支部サマースクール 2015

日時: 2015 年 8 月 5 日(水), 6 日(木)

場所: 稚内総合文化センター(稚内市中央 3 丁目)

プログラム:

8 月 5 日(水)

10:00 – 11:00 “Nominal and Real Interest Rates in a General Equilibrium Framework (joint work with Hiroshi Morita)” 西出勝正, 横浜国立大学

11:00 – 12:00 “Discretization of vol-of-vol expansion(仮)”, 山田俊皓, 一橋大学

13:30 – 14:30 「為替レートに対する連続制御と制限をおいた確率インパルス制御」安田和弘,
法政大学

14:30 – 15:30 “Investment timing, collateral, and financing constraints” 芝田隆志,
首都大学東京

15:30 – 16:00 ”Optimal decision for hostile takeover”, 陳文君, 北海道大学

16:00 – 16:30 未定

8 月 6 日(木)

10:00 – 12:00 Lecture “Financial Calculus: An introduction to derivative pricing” 陳文君,
北海道大学

13:30 – 16:00 同上

内容: Baxter and Rennie による同名のテキストを用いて, ファイナンスに利用される確率過程に関する基礎を講義し, ブラックショールズモデルの導出を行う.

(2) Winter Workshop on Operations Research, Finance and Mathematics, 2016

Venue: Sahoro Resort Hotel, Hokkaido, Japan

Date: Feb. 15th (arriving date) – 19th (departure date), 2016.

Program

Feb. 15

9:00 – 12:00, Survey on Advanced Corporate Finance (1)

by Takashi Shibata, Tokyo Metropolitan University

14:00 – 14:40 Mikhail Zhitlukhin, “New approaches to performance measurement”

14:40 – 15:20 Kazutoshi Yamazaki, “An Analytic Recursive Method for Optimal Multiple Stopping: Canadization and Phase-Type Fitting”

15:40 – 16:20 Kazuhiro Yasuda, “Weak convergence rates of the Euler–Maruyama approximation with discontinuous drifts”

16:20 – 17:00 Tomonori Nakatsu, “On density function concerning maxima of diffusion processes”

17:10 – 17:50 Hidetoshi Nakagawa, “Some applications of an earning-based structural model to credit risk measurements”

Feb. 16

9:00 – 12:00, Survey on Advanced Corporate Finance (2)

by Takashi Shibata, Tokyo Metropolitan University

14:00 – 14:40 Konstantin Borovkov, “Approximating welfare in large efficient markets”

14:40 – 15:20 Chiaki Hara, “Implied Ambiguity and Ambiguity Aversion” 15:40 – 16:20 Christopher Ting, “The Market Price of Liquidity Risk: Models and Empirical Findings”

16:20 – 17:00 Jun Sekine, “Prediction with Noisy Anticipation and Its Application to Asset Pricing”

17:10 – 17:50 Takashi Shibata, “Investment timing under financing constraints based on collateral”

Feb. 17

9:00 – 12:00, Case Studies and Basic Methods for Sport Finance (1)

by Makoto Goto, Hokkaido University

14:00 – 14:40 Alex Novikov, “Approximations to distributions of weighted Kolmogorov–Smirnov statistics via boundary crossing probabilities”

14:40 – 15:20 Martin Larrson, “Semi-static completeness and robust pricing by informed investors”

15:40 – 16:20 Tadao Oryu, “Explicit Solutions for Optimal Stopping of Maximum Process with Absorbing Boundary That Varies with It”

- 16:20 – 17:00 Toshihiro Yamada, “A weak approximation of SDEs: application to computational finance”
- 17:10 – 17:50 Masaaki Fukasawa, “Asymptotic replication with modified volatility under small transaction costs”

Feb. 18

- 9:00 – 12:00, Case Studies and Basic Methods for Sport Finance (2)
by Makoto Goto, Hokkaido University
- 14:00 – 14:40 Yuri Kabanov, TBA
- 14:40 – 15:20 Lioudmila Vostrikova, “On exponential functionals of processes with independent increments”
- 15:40 – 16:20 Soichiro Moridaira, “The Option Pricing Model for Normally Distributed Underlying and Its Applications. Why It Is So Fantastic!”
- 16:20 – 17:00 Kyoko Yagi, “Debt–Equity Swap and Strategic Debt Service with Firms’ Cross–holdings of Debts”
- 17:10 – 17:50 Cui Xue, “Effects of reversibility on investment timing and quantity strategies”

Feb. 19

- 9:00 – 12:00, Case Studies and Basic Methods for Sport Finance (3)
by Makoto Goto, Hokkaido University
- 14:00 – 14:40 Yue Kuen Kwok, “Pricing discrete timer options under stochastic volatility models”
- 14:40 – 15:20 Takanori Adachi, “A framework for analyzing stochastic jumps in finance based on belief and knowledge”
- 15:40 – 16:20 Go Yuki, “Density Functions for SDEs with Discontinuous Drift Coefficients”
- 16:20 – 17:00 Kimitoshi Sato, “Effects of competitor presence on price trends in a dynamic pricing”
- 17:10 – 17:50 Juri Hinz, “Pathwise approach to high–dimensional stochastic control in financial applications”

5. 普及活動およびその他の活動

Web ページ更新(随時)

(2)平成 27 年度収支決算報告書(案)

1. 収支決算書

自)平成 27 年 3 月 1 日

至)平成 28 年 2 月 29 日

| 科目 | 予算額(円) | 決算額(円) | 備考 |
|--------|----------|----------|--------------|
| (収入の部) | | | |
| 本部交付金 | 234, 200 | 234, 200 | 支部運営費 |
| 参加費 | 30, 000 | 35, 000 | サマースクール |
| | | 192, 000 | ウインターワークショップ |
| 雑収入 | 20 | 44 | 利息収入 |
| 合計 | 264, 220 | 461, 244 | |
| (支出の部) | | | |
| 会議費 | 50, 000 | 0 | |
| 講演会費 | 120, 000 | 99, 580 | 講師謝礼・旅費 |
| 研究会費 | 60, 000 | 70, 600 | サマースクール |
| | | 191, 085 | ウインターワークショップ |
| 事務費 | 5, 000 | 0 | |
| 消耗品費 | 0 | 0 | |
| 源泉税返還 | 10, 000 | 28, 980 | |
| 雑費 | 10, 000 | 0 | |
| 予備費 | 9, 220 | 0 | |
| 本部返金 | 0 | 70, 783 | |
| 合計 | 264, 220 | 461, 244 | |

監査報告書

公益社団法人 日本オペレーションズリサーチ学会北海道支部
支部長 山本 雅人 殿

平成27年度(平成27年3月1日から平成28年2月29日迄)の事業報告、収支決算
報告を監査した結果、適法に処理、記載されていると認める。

以上

平成28年4月8日

公益社団法人 日本オペレーションズリサーチ学会北海道支部
監事 木下 正博 

監査報告書

公益社団法人 日本オペレーションズリサーチ学会北海道支部
支部長 山本 雅人 殿

平成27年度(平成27年3月1日から平成28年2月29日迄)の事業報告、収支決算
報告を監査した結果、適法に処理、記載されていると認める。

以上

平成28年4月8日

公益社団法人 日本オペレーションズリサーチ学会北海道支部

監事

大津 晶



(4)平成 28 年度事業計画(案)

1. 通常総会

日時:平成 28 年 4 月 8 日(金) 18:30~19:00

場所:小樽商大札幌サテライト 小講義室 (札幌市中央区北 5 条西 5 丁目 7 番地)

議題:平成 27 年度事業報告・決算報告,平成 28 年度事業計画・予算(案),他

2. 運営委員会

1~2回開催予定

3. 講演会, 研究会

4回程度開催予定

4. 普及活動およびその他の活動

ホームページの更新, 他

(5)平成 28 年度支部運営費予算(案)

自)平成 28 年 3 月 1 日

至)平成 29 年 2 月 28 日

| 科目 | 予算額(円) | 備考 |
|--------|----------|--------------|
| (収入の部) | | |
| 本部交付金 | 234, 200 | 支部運営費 |
| | 100, 000 | 支部事業費 |
| 参加費 | 50, 000 | サマースクール |
| | | ウインターワークショップ |
| 雑収入 | 50 | 利息収入 |
| 合計 | 384, 250 | |
| (支出の部) | | |
| 会議費 | 0 | |
| 講演会費 | 200, 000 | 支部講演会 |
| 研究会費 | 50, 000 | サマースクール |
| 事業費 | 100, 000 | ウインターワークショップ |
| 事務費 | 0 | |
| 消耗品費 | 0 | |
| 源泉税返還 | 18, 000 | |
| 雑費 | 0 | |
| 予備費 | 16, 250 | |
| 合計 | 384, 250 | |