

日本オペレーションズ・リサーチ学会北海道支部 平成 29 年度 第1回運営委員会、支部総会

日時:平成 29 年 4 月 7 日(金) 18:00~19:00

場所:小樽商大札幌サテライト (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 28 年度事業報告
 - (2)平成 28 年度収支決算報告ならびに監査報告
 - (3)平成 29 年度役員(案)
 - (4)平成 29 年度事業計画(案)
 - (5)平成 29 年度予算(案)
 - (6)その他
5. 閉会の辞

議題

(1)平成 28 年度事業報告

1. 通常総会、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)

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 年度事業計画(案)
- (4) 平成 28 年度予算(案)
- (5) 平成 28 年度役員(案)
- (6) その他

2. 講演会

(1)第1回講演会

日時:平成 28 年 10 月 28 日(金) 13:30~17:30

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

講演 1

テーマ:粒子エージェントによる最適化アプローチ

講師:加地 太一 先生(小樽商科大学商学部 教授)

概要:最適化問題の新たなパラダイムである粒子群最適化法(PSO)は、多峰性の大域的最適化問題に対して精度の高い解を導き出していることは知られている。しかし、高次元空間では、早い段階で局所解に落ち込む特徴が PSO にあり、その能力が発揮されない傾向がみられる。そこで、本講演では、高次元空間において早い段階で局所解に落ち込まず、より質の良い解を探索可能とする PSO の新パラダイムを検討したい。ここでは、PSO の能力を向上させるため、広く探索を行わせる戦略(多様化)、かつ良い解の周りを集中的に探索する戦略(集中化)を強化した粒子エージェントを作り上げる。かつ粒子群がもつ情報を意図的に更新することにより過去の情報に束縛されず広い探索を実現可能とし優位な解に到達させる。また、広範囲なパラメータ値、その様々な組合せによりアルゴリズムの振る舞い、得られるコストの変化などを詳細に調べ、本アルゴリズムの特性を改めて再考したい。

講演 2

テーマ:群知能と複雑系の制御

講師:生天目 章 先生(米空軍研究所科学技術局アジア事務所、防衛大学名誉教授)

概要:群知能(swarm intelligence)は、鳥の群れに見られるように、個体間の局所的な相互作用を通じて、集団として高度な知性的な行動が現れる創発現象を指し、その具現化に関する計算手法に関する研究が長年されてきている。特に、集団全体を統御するリーダーはなく、個体全員が平等な立場で相互作用する中、全体の知性が生まれるボトムアップな方法に研究者は、長年虜になってきた。また、群知能をさまざまな問題に応用する研究も活発である。その中で、障害物回避など、がいかにして再構築されるのかなどの自律的な制御問題、群れ行動を目的地へ誘導するなどの外から制御に関する研究なども着目されている。

本発表では、群れの自律的制御、また目的地へ誘導するなどの群れ制御には、個体間のネットワークの制御が鍵を握ることについて議論する。また群れ行動の制御から得られた知見の複雑系の制御への応用などについて議論する。

(2) 第 2 回講演会

日時:平成 29 年 1 月 27 日(金) 17:00~18:30

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

講演 1

テーマ:データサイエンティストの思考法

講師:岩田 泰士 氏(新日鉄住金ソリューションズ株式会社技術本部システム研究開発センター)

概要:新日鉄住金ソリューションズ(NSSOL)と金融エンジニアリング・グループ(FEG)の混成チームは、データ分析の世界大会である「KDD Cup 2015」(主催:ACM 学会の分科会 SIGKDD)で、第 2 位に入賞しました。本講演では同チームのメンバーが、大会において何に注目し、何をどう考えていったのか、データサイエンティストの思考法について、大会での実際の作業内容を交えながら紹介します。

3. 研究会

(1) 北海道支部サマースクール 2016

日時:2016 年 6 月 8 日(水), 9 日(木)

場所:函館市地域まちづくりセンター(函館市末広町 4 番 19 号)

プログラム:

6 月 8 日(水) 国際研究集会

9:30 - 10:30 “On Uniqueness of Clearing Vectors Reducing the Systemic Risk,” Yuri Kabanov, Université de Franche-Comté

10:30 - 11:30 “Default Contagion and Systemic Risk in a Financial Network with Credit Default Swap”, Teruyoshi Suzuki, Hokkaido University

13:30 - 14:30 TBA, Arturo Kohatsu-Higa, Ritsumeikan University

14:30 - 15:30 “Study on dynamic correlation of stock returns for change point detection,” Takashi Isogai, Tokyo Metropolitan University

6 月 9 日(木) 「評価の OR」研究部会ジョイントセミナー

9:30 -10:30 DEA チュートリアル, 上田徹(成蹊大学)

10:30-11:30 AHP・ANP チュートリアル, 関谷和之(静岡大学)

評価の OR 研究部会

13:30-14:30 “ROW AND COLUMN GENERATION ALGORITHM FOR MINIMUM MARGIN MAXIMIZATION OF RANKING PROBLEMS”, 山本芳嗣(静岡大学)

14:30-15:30 野球・サッカー・ラグビーの選手評価(仮), 廣津信義・木内誠(順天堂大学)

(2) Winter Workshop on Operations Research, Finance and Mathematics, 2017

日時:2017 年 2 月 20 日(月)から 24 日(金)

場所:定山溪

Feb. 20

Session 1 (Chair: Masaaki Kijima)

15:00-15:40 Yuri Kabanov, TBA

15:40-16:20 Nan Chen, TBA

Session 2 (Chair: Liudmila Vostrikova)

16:35-17:15 Alex Novikov, “On Limit Distributions of Statistics Arising in Irregular Cusp-type Statistical Models: The Case of fBm”

17:15-17:40 Kazutoshi Yamazaki, “Optimal Double Stopping of a Brownian Bridge”

Session 3 (Chair: Mikhail Zhitlukhin)

17:55–18:35 Min Dai, “Optimal Tax–timing with Transaction Costs”
18:35–19:00 Yuan Tian, “Debt Rollover, Bankruptcy, and Debt Maturity”

Feb. 21

9:00 –13:00 Advanced Lecture: “Introduction to Asset Pricing in Economics I” by Chiaki Hara, Kyoto University (in Japanese)

Session 4 (Chair: Christopher Ting)

15:00–15:40 Liudmila Vostrikova, “On Distributions of Exponential Functionals of the Processes with Independent Increments”

15:40–16:20 Mikhail Zhitlukhin, “On Quasi–convex Probabilities and Related Functionals”

Session 5 (Chair: Takashi Shibata)

16:35–17:15 Sebastian Jaimungal, “Trading Algorithms with Learning in Latent Alpha Model”

17:15–17:40 Michi Nishihara, “Bankruptcy Decision under Asymmetric Information”

Session 6 (Chair: Alex Novikov)

17:55–18:35 Konstantin Borovkov, “On Limit Order Books Modelling”

18:35–19:00 Koichi Matsumoto, “Optimal Hedging Strategy in an Uncertain Model”

Feb. 22

9:00 –13:00 Advanced Lecture: “Introduction to Asset Pricing in Economics II” by Chiaki Hara, Kyoto University (in Japanese)

Session 7 (Chair:Konstantin Borovkov)

15:00–15:40 Yue Kuen Kwok, “Saddlepoint Approximation Methods for Pricing Financial Options on Discrete Realized Variance”

15:40–16:00 Takefumi Amaba, “A Discrete–Time Clark–Ocone Formula and its Application to an Error Analysis”

16:00–16:20 Go Yuki, “Convergence Implications via Dual Flow Method”

Session 8 (Chair: Yue Kuen Kwok)

16:35–17:15 Christopher Ting, “Application of Stochastic Calculus to Price a Quanto Spread”

17:15–17:40 Kazuhiro Yasuda, “An Optimal Investment Strategy for Insurance Companies with a Linear Gaussian Stochastic Factor Model”

Session 9 (Chair: Juri Hinz)

17:55–18:35 Hyeng Keun Koo, “Optimal Consumption and Portfolio Selection with Early Retirement Option”

18:35–19:00 Yong Hyun Shin, “An Optimal Consumption, Gift, Investment, and Voluntary Retirement Choice Problem with Quadratic and HARA Utility”

Feb. 23

9:00 –13:00 Advanced Lecture: “Asset Pricing Theory I” by Katsumasa Nishide, Hitotsubashi University (in Japanese)

Session 10 (Chair: Xunyu Zhou)

15:00–15:40 Juri Hinz, “Optimal Energy Supply Shift with Battery Storages”

15:40–16:00 Kum–Hwan Roh, “An Optimal Consumption and Investment Problem with Quadratic Utility and Negative Wealth Constraints”

Session 11 (Chair: Yuri Kabanov)

16:15–16:55 Tom Fischer, “Derivatives and Debt in the Structural Model of Financial Networks”

16:55–17:20 Katsumasa Nishide, “Default Contagion and Systemic Risk in the Presence of Credit Default Swaps”

Session 12 (Chair: Teruyoshi Suzuki)

17:35–18:15 Xunyu Zhou, “Weighted Discounting — On Group Diversity, Time–inconsistency, and Consequences for Investment”

18:15–18:40 Takanori Adachi, “A Category of Probability Spaces”

Feb. 24

9:00 -13:00 Advanced Lecture: "Asset Pricing Theory II" by Katsumasa Nishide, Hitotsubashi University (in Japanese)

4. 普及活動およびその他の活動

Web ページ更新(随時)

(2)平成 28 年度収支決算報告書

1. 収支決算書

自)平成 28 年 3 月 1 日


至)平成 29 年 2 月 28 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
	100, 000	100, 000	支部事業費
参加費	50, 000	0	
雑収入	50	1	利息収入
合計	384, 250	334, 201	
(支出の部)			
会議費	0	18, 530	支部総会懇親会
講演会費	200, 000	166, 902	講師謝礼
研究会費	50, 000	9, 000	サマースクール会場費
	50, 000	107, 748	ウインターワークショップ
	50, 000	0	支部研究会費
事務費	0	0	
消耗品費	0	0	
源泉税返還	18, 000	31, 230	
雑費	0	876	封筒、郵送料
予備費	16, 250	0	
本部返金	0	△85	本部から入金
合計	384, 250	334, 201	

監査報告書

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 28 年度(平成 28 年 3 月 1 日から平成 29 年 2 月 28 日迄)の事業報告、決算報告、現金出納帳、及び附属明細書を監査した結果、適法に処理、記載されていると認める。

監事 木下正博 

監査報告書

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 28 年度(平成 28 年 3 月 1 日から平成 29 年 2 月 28 日迄)の事業報告、決算報告、現金出納帳、及び附属明細書を監査した結果、適法に処理、記載されていると認める。

監事 大津 品 

(3)平成 29 年度日本OR学会北海道支部役員(案)

支部長	川村秀憲	北海道大学大学院情報科学研究科		
副支部長	鈴木輝好	北海道大学大学院経済学研究科		
運営委員	飯塚博幸	北海道大学大学院情報科学研究科		
	石井利昌	北海道大学大学院経済学研究科		
	大堀隆文	北海道科学大学メディアデザイン学科		
	加地太一	小樽商科大学社会情報学科		代議員
	北 裕幸	北海道大学大学院情報科学研究科		
	後藤 允	北海大学大学院経済学研究科		
	斎藤 一	北海道情報大学情報メディア学科		
	佐藤馨一			
	鈴木育男	北見工業大学情報システム工学科		
	鈴木恵二	公立はこだて未来大学複雑系知能学科		
	高野伸栄	北海道大学大学院工学研究科		
	行方常幸	小樽商科大学社会情報学科		
	福居文継	北電情報テクノロジー情報技術部		代議員
	三田村 保	北海道科学大学メディアデザイン学科		研究普及委員
	原口和也	小樽商科大学社会情報学科		
	山本雅人	北海道大学大学院情報科学研究科		
	西川孝二	北海道科学大学メディアデザイン学科		
	長尾光悦	北海道情報大学システム情報学科		
監事	大津 晶	小樽商科大学社会情報学科		
	木下正博	北海道科学大学メディアデザイン学科		
幹事(研究)	山下倫央	北海道大学大学院情報科学研究科		研究普及委員
幹事(事務)	横山想一郎	北海道大学大学院情報科学研究科		

(4)平成 29 年度事業計画(案)

1. 通常総会

日時:平成 29 年 4 月 7 日(金) 18:00~19:00

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

議題:平成 28 年度事業報告・決算報告,平成 29 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

2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 29 年度支部運営費予算(案)

自)平成 29 年 3 月 1 日
至)平成 30 年 2 月 28 日

科目	予算額(円)	備考
(収入の部)		
本部交付金	215, 200	支部運営費
雑収入	50	利息収入
合計	215, 250	
(支出の部)		
会議費	0	
講演会費	180, 000	支部講演会
消耗品費	0	
源泉税返還	18, 000	
雑費	0	
予備費	17, 250	
合計	215, 250	