

## 金融危機を OR 普及の契機に

日本オペレーションズ・リサーチ学会会長  
南山大学 教授

伏見 正則



OR 学会会員の皆様、新年をどのようにお迎えでしょうか。

新年の挨拶は「明けましておめでとうございます」で始まるのが慣例ですが、本年は心から「おめでとうございます」とは申し上げ難い状況にあります。サブプライムローン問題を引き金とするアメリカの金融危機が全世界に波及し、本稿執筆時点（11月初め）では、当初の大混乱は少し収まったように見受けられますが、相変わらず世界の各株式市場で株価の乱高下が続いています。また、先進各国が公的資金注入などの対策を講じたにもかかわらず、実体経済への影響は深刻で、アメリカでは大手自動車メーカーが苦況に陥っていますし、わが国でも大企業から中小の企業まで、多くの企業に影響が出ています。このような状況から脱却できるのは、相当先になるのではないのでしょうか。

OR の分野では、制約条件の下で最適化を図るのが一般的ですが、今回のアメリカ発の金融危機は、制約条件を忘れて金融工学を駆使して（悪用して？）最適化(?)を目指したのが悪かったのではないのでしょうか。われわれ OR 学会会員としては、改めて「制約条件を守っての最適化」を肝に銘じるとともに、この精神を世の中に広めていきたいものだと思います。

目を OR 学会自体に向けてみますと、こちらも厳しい状況におかれています。それは、賛助会員、一般会員数の減少です。これは、ずいぶん前から続いている現象で、あるときには“底を打ったのではないか”といわれたこともありますが、実際

には歯止めがかかっていません。例えば、一般会員数は、ここ十年間くらいの間、毎年約 50 人ずつ減り続けていて、2 千人を割るかどうかの瀬戸際に立たされています。これはほぼ 25 年前の水準です。今回の金融危機による経済の混乱の影響が賛助会員数のさらなる減少につながらないように祈るばかりです。

会員数の減少傾向は、OR 学会に限りませんが、だからといって、世間並みだから仕方がないといっているわけにはいきません。学会は 1 年あまり前に創立 50 周年を祝ったばかりですが、半世紀にわたって先輩たちが築き上げてきた伝統を守り、さらに発展をするように努めなければなりません。

OR 学会が発足当初から目指し、守ってきた伝統の一つは、理論的研究と実践のバランス、また理事会や委員会の構成における大学・研究機関所属の会員と企業所属会員のバランスであったと思います。ところが、このバランスが最近崩れてきているのではないかと危惧されます。上記のような会員数の減少は、これと無関係ではないかと思われれます。どちらが原因で、どちらが結果であるかは、よくわかりませんが。

企業が苦況に立たされている今こそ、OR の普及に努めるべき時期と考えて、会員の皆様のご努力をお願いしたいと思います。これに関連して思い出すことがあります。私が勤務している南山大学の学長カルマノ神父がメールマガジン EPIS-TOLA（2008 年 4 月号）の中で述べていることです（私がここで述べるのは、門前の小僧のお経で、換骨奪胎ですが、原文はホームページでご覧

いただけます)。

マタイによる福音書の中に「汝らは世の光なり」という言葉があります。いろいろな問題をかかえている世の中をもう少し明るい場所にするのは“OR学会会員の使命である”と考えましょう。堀辰雄の『風立ちぬ』の中に、主人公が富士見高原の村の家でクリスマスイブを過ごしてから、雪明かりのした谷蔭を谷の上の方の自分の小屋に向かってひとりで帰ってきたときのことが書かれています。「道傍に雪をかぶって一塊りに塊っている枯藪の上に、何処からともなく、小さな光が幽かにぼつんと落ちているのに気がついた。こんなところにこんな光が、どうして射しているのだろうと訝りながら、そのどっか別荘の散らばった狭い谷じゅうを見まわして見ると、明りのついているのは、たった一軒、確かに私の小屋らしいのが、ずっとその谷の上方に認められるきりだった。……あっちにもこっちにも、殆どこの谷じゅうを掩うように、雪の上に点々と小さな光の散らばっているのは、どれもみんなおれの小屋の（僅かな）明りなのだ……」

世の光になるためには、野球場の照明に匹敵するような大規模な組織は不要で、わずかな光で十分であるというのがカルマノ学長の記事の趣旨と思われまふ。ORの実践についても、大規模な実践を行おうとすると、気後れがしてしまつて、にわかには実行が難しいかもしれませんが、自分のまわりをわずかに照らす程度の光（実践）であれば良いと考えれば、気軽に実行できるのではないのでしょうか。そして、会員の皆様が、ご自分のまわりを照らしていただければ、それがORの普及につながり、世の中全体を明るくしてくれるものと期待されます。南山学園・南山大学は、INFORMSのFranz Edelman Prizeのファイナリスト賞とOR学会の実施賞を受賞しましたが、これも草の根を照らすようなわずかな光の集まりの結果であると考えています。近年の18歳人口の減少や、国からの運営交付金の減少などの影響で、大学や研究機関も、国公私立を問わず厳しい

状況におかれていますので、企業だけでなく、大学あるいは研究機関でも、ORの実践のチャンスはたくさんあるのではないのでしょうか。どうぞ、「ORは役に立つ」という認識を世の中に広めてくださるようお願いいたします。

実践の結果は、広く世の中に公開したいものです。従来、実践の結果はOR事典の事例編に収録し、またOR学会編の単行本「OR事例集」という形で公開してきました。そして学会創立40周年記念事業の一つとして事典の電子化が行われ、さらに50周年記念事業としてORWikiとしてインターネットで公開されました。その後、基礎編については、編集委員の皆様の献身的なご努力によって改訂作業が進められていますが、事例編については手つかずのままとなっています。早急に実践例の収集・編集をする体制を作り、貴重な財産を世の中に公開することが重要ではないかと考えています。

ORの実践には、データの収集・分析が欠かせません。私は、

“モデル”+“データ”=“OR”

という自己流の等式(?)を作つて学生諸君に説明しています。ORにとってモデリングが重要であることは言うまでもありませんが、データもモデルに劣らず重要です。大学院を終えたばかりのころ、あるプロジェクトでいろいろ考えてモデルを作つたのですが、それに使えるようなデータは世の中に存在しないと言われた苦い経験があり、以後この等式を肝に銘じている次第です。このようなわけで、モデルや基本的手法と並んで、データもOR学会あるいは広く社会にとって重要な知的財産であると思います。そこで、研究部会や会員の皆様から、差し支えない範囲でデータを提供していただいて、ORWikiなどの媒体を通じて公開し、ORの教育や普及に役立てられないかと考えています。

本年が会員の皆様にとって良い年になりますように、また会員の皆様のご協力により、社会が明るくなりますように願っております。