研究部会報告

情報システムの戦略的活用

・第4回

日時：平成3年9月21日（土）14：00～17：00

出席者：31名

場所：芦大クラブ（大阪市南区）

テーマと講師：「マイカルグループの戦略と情報システム」卜部邦彦（㈱マイカルシステムズ）

流通・小売業界において情報技術・情報システムの導入がどのように行なわれてきたかが概説され，今日の激変する消費環境のもとで流通・小売業界が直面する諸問題ならびにそれらの諸問題に対して情報システムに課せられた役割・課題がマイカルグループの事例を通して紹介された．

・第5回

日時：平成3年10月19日（土）14：00～16：30

出席者：29名

場所：芦大クラブ（大阪市南区）

テーマと講師：「垣間見た欧米情報活用事情」辻新六（神戸商科大学）

5月から8月までの在外研究の成果をもとにヨーロッパならびにアメリカでの情報システムならびに情報技術の活用の事例が紹介され，組織構造，企業間ネットワーク，情報教育などの側面から情報システムを戦略的に活用していく上での問題点や課題が示された．

・第6回

日時：平成3年11月16日（土）14：00～16：30

出席者：17名

場所：芦大クラブ（大阪市南区）

テーマと講師：「ＣＩＭの構築と組織構造」湊晋平（松山大学）

ＣＩＭの導入が叫ばれているが，各種統計資料を利用することによって，生産力の主要な経営資源の1つである労働力が変質していることが指摘され，さらにＣＩＭを導入するにふさわしい組織構造のあり方が示され，これらの点について議論が行なわれた．

・第7回

日時：平成3年12月7日（土）14：00～16：30

出席者：21名

場所：芦大クラブ（大阪市南区）

テーマと講師：「価値観の変遷と戦略目標の再考」法雲俊邑（龍谷大学）

ブームとして近年とりあげられているＳＩＳについて，戦略目標という観点からＳＩＳの再評価が行なわれた．まず，企業の価値観が収益性を重視する方向へシフトしていることが示され，このような傾向の中で収益性の追求のみを目標とするＳＩＳのコンセプトに対する疑問が提起され，顧客満足などの目標をも考慮すべきであることなどが指摘された．

数理モデルとその周辺

・第24回

日時：平成3年9月28日（土）14：00～17：00

出席者：11名

場所：九州大学経済学部

テーマと講師：(1)「金融機関における情報システムのあり方」高宮哲郎（西日本銀行システム部）西日本銀行で汎用機とパソコンとの間でデータ，ソフトウェア交換を効率的に行なうＯＡシステムを開発した事例を報告した

(2)「ゲームと情報について」甲斐裕（福岡女子大学家政学部）従来のゲーム理論には不確実性などの情報に関するモデルが導入されていない点を指摘し，これを改善する方法論について述べた．

・第25回

日時：平成3年11月16日（土）14：00～17：00

出席者：13名

場所：九州大学経済学部

テーマと講師：(1)「音声認識におけるＤＰの応用」迫江博昭（九州大学工学部）計算機による音声の自動認識に2段階のＤＰを導入する方法論について述べ実際の認識効率やハードウェアによる実現について報告した．

(2)「動的計画から両的計画へ」岩本誠一（九州大学経済学部）動的計画における単調性の概念を拡張して非減少性，非増加性にいずれかを含む概念を両調性として導入し定理や数値例について述べた．

・第26回

日時：平成3年12月21日（土）14：00～17：00

出席者：15名

場所：九州大学経済学部

テーマと講師：(1)「The distribution of the full

© 日本オペレーションズ・リサーチ学会．無断複写・複製・転載を禁ず．

information maximum likelihood estimator」大屋幸輔，森棟公夫（京都大学経済研究所）経済マクロモデルの推定における最尤法適用にあたり，情報の正規性からのズレを補正する展開法の有効性をシミュレーションで確認した．

(2)「双線形時系列モデルについて」中村博和（佐賀大学経済学部）双線形時系列モデルを導入する意義やその数理的性質，係数推定の方法などについて，今まで行なってきた研究の成果をまとめ報告した．

◎合意形成と対外政策◎

・第17回

日時：平成3年12月21日（土）14：00～17：00

出席者：9名

場所：三菱総研3Fセミナー室

テーマと講師：「生成発展の社会分子構造について」井上成一（日本治水，一水会）

氏が会社運営実践上，原点から財務諸表のあり方に取り組む裡に体得された生成輪廻の新思考は，螺旋状の遺伝子構造を社会分子構造に引写するものであり，鳥瞰すると，種・草木・花・実の4局面を対置し，境界にファジィ領域をもつ円の中に全事象が凝縮されるとし，そのすぐれた理論家かつ実践者としての二宮尊徳などの一生を例に講演され，強い感銘を与えられた．

●金融と投資のOR●

・第8回

日時：平成3年12月21日（土）14：00～17：00

出席者：49名

場所：東京工業大学百年記念館3Fフェライト会議室

テーマと講師：(1)「プラス・アルファ・ファンド――考え方と構築の方法」安達智彦（日本証券経済研究所）

資産運用のパフォーマンス評価はシャープ制度（リスク1単位当たり超過収益率）で計測される．プラス・アルファ・ファンドとは，インデックスファンドと比べて分散とベータ値は同じだが，期待収益率が高いファンドのことである．もしプラス・アルファ・ファンドが作れるならば，先物を利用してアルファ裁定ができ，より高い収益率を上げることができることを示した．そしてテクニカルな条件やファンダメンタルな条件を利用してどのようにプラス・アルファ・ファンドを作るかの方法論と実際データを用いた検証結果について報告した．

(2)「ルックバックオプションの評価について」河合一（鳥取大学工学部社会開発システム工学科）

行使価格が株式のサンプルパスに依存するヨーロピアン・ルックバックオプションの価格評価を2項過程を用いて行なった．離散時間2項型オプション価格モデルは数学的に単純であり，ある極限操作を施すとGoldman, Sosin, Gatto による幾何ブラウン運動を仮定した連続型モデルと同じ結果を与えることを示した．

●人間的グローバル経営システム◎

・第10回

日時：1月11日（土）14:00～17:00

出席者：10名

場所：東京都勤労福祉会館（中央区新富）

テーマと講師「内外情勢の展望」佐藤永充（M&M戦略研究所理事長）

1991年の世界は湾岸戦争とソ連邦の消滅を2つの軸として展開した，世界の新しい秩序作りが模索されはじめたが，実際には，米ソの和解が逆に混迷を生んだ．また第三世界間の紛争も激化した．一方，国内政局も，バブルの崩壊・リクルート問題の再燃と問題が多く，宮沢内閣は通常国会を乗り切れるか，参院選で勝てるか，問題だ．

会合記録

1月8日(水)　IAOR委員会　2名
1月13日(月)　表彰委員会　9名
1月13日(月)　普及小委員会　4名
1月14日(火)　庶務幹事会　8名
1月16日(木)　普及小委員会　4名
1月17日(金)　研究普及委員会　9名
1月20日(月)　編集委員会　13名
1月21日(火)　理事会　15名
1月24日(金)　企業サロン企画委員会　4名

第5回理事会議題

(4－1－21)

1. 平成3年度第4回理事会議事録の件
2. 入退会の件
3. 平成2年度・3年度会費未納者(除名対象者)の件
4. 各委員会報告
   第3・四半期収支報告の件
   研究部会の新設ならびに継続の件
   秋季研究発表会およびRAMPシンポジウム収支決算報告の件
   第27回シンポジウム実行委員会および予算案の件
   平成4年度秋季研究発表会実行委員会構成の件
   平成4年度事業計画・予算案の件
5. その他

© 日本オペレーションズ・リサーチ学会．無断複写・複製・転載を禁ず．