



研究部会報告

●OR/MSとシステム・マネジメント●

(1)日時：平成3年6月8日(土)13:30～17:00 出席者：30名
場所：東京工業大学百年記念館 会議室
テーマと講師：「最近の戦略論とOR」 今居謹吾（専修大学 経営学部 教授）

経営の戦略論が近年どのように発展してきたか、それにともなる戦略の実践がどのように変わってきたかが事例を用いて解説された。さらに戦略の実践とORの考え方との関係が論じられた。

(2)日時：平成3年9月14日(土)13:30～17:00 出席者：25名
場所：東京工業大学百年記念館 会議室
テーマと講師：「知識知能を向上するためのメタゲーム」 柴田祐作(SINPLE-MEGANET 社)

組織の知能を向上させるためには制約の弱いメタゲームを用いる組織づくり、戦略実施が重要であることを論じ、生産現場にこのメタゲームを適用する方法を論じた。

(3)日時：平成3年11月9日(土)13:30～17:00 出席者：32名
場所：東京工業大学百年記念館 会議室
テーマと講師：「CIMの採算計算」 桜井通晴（専修大学 経営学部 教授）

CIM投資額はますます増大してきており、採算性が不明確になっている。そこで本講演ではCIM投資の採算計算に計量化できない要因、計量化しにくい要因、計量化できる要因を分類し、それぞれに対する評価方法を与え総合評価する方法および考え方が論じられた。

(4)日時：平成3年12月14日(土)13:30～17:00 出席者：35名
場所：東京工業大学百年記念館 会議室
テーマと講師：「自動車会社の組織統合性」 藤本隆宏（東京大学 経済学部 助教授）

世界の自動車会社の製品開発に関する6年間にわたるぼう大な実態調査結果の報告がなされた。その結果、組織統合性という概念を用いて各社の戦略を評価する方法が示された。本研究発表をつうじて組織はうまく統合されればいかに力を発揮するか、また逆に働けばいかに衰退するかが明らかにされた。

(5)日時：1月25日(土)13:30～17:00 出席者：45名

場所：東京工業大学百年記念館 会議室

テーマと講師：「組織知能と戦略的情緒—ORモデルによる情緒—」 松田武彦（産能大学 学長）

組織のもつ知能が発揮されるには戦略的情緒（戦略のための情報が脈絡をもって与えられるもの）が必要であることがまず示された。ついでORモデルをその情緒を構造的に表示したものであると考え、組織知能と戦略的情緒（あるいはORモデル）についてより実践的考察が与えられた。その後新年会を行ない相互の親睦をはかった。

●巨大プロジェクトに関するOR●

●第1回

日時：平成3年12月6日(金)18:00～21:00 出席者：10名

場所：筑波大学大塚キャンパス

テーマと講師：「研究部会の設立趣旨」 柳井 浩（慶応大学）、「G I Fプロジェクトについて」 山元順雄（日本G I F研究財団）

柳井氏より研究部会設立の趣旨説明の後、山元氏より日本G I F財団の設立目的、経過、委託研究の狙い、巨大プロジェクトの概要について説明を受けた。

●第2回

日時：1月20日(月)16:00～18:00 出席者：10名

場所：筑波大学大塚キャンパス

テーマと講師：「水資源の巨大プロジェクト」 藤野成人（日本G I F研究財団）

水資源をめぐる巨大プロジェクト構想の現状と問題点を、主として中東におけるピースウォーターパイプライン構想を中心に講演された。

●第3回

日時：3月2日(月)16:00～18:00 出席者：6名

場所：筑波大学大塚キャンパス

テーマと講師：「巨大プロジェクトの評価」 上川陽子（グローバルリンク総研）

巨大プロジェクトの評価方法について、従来の考え方と上川氏の提唱する考え方を講演された。

●金融と投資のOR●

●第10回

日時：2月22日(土)14:00～17:00 出席者：33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)「標準MVポートフォリオ選択モデルにおける有効フロンティアについて」中里宗敬（東京工業大学工学部経営工学科）

マーコピッツの標準MVポートフォリオ選択モデルについて解説した。モデルをパラメトリックに解いて得られる有効フロンティアについて分析を行ない、[1]有効フロンティアに関する資産は少数（936銘柄中60銘柄程度）、[2]有効フロンティアは月次ベースでは不安定、[3]市場インデックス（日経225）の投資パフォーマンスはかなり低い、などの特徴を示した。また、東証一部上場の936銘柄を用いて、「60カ月間分析を行ない、その後1カ月投資する」という投資シミュレーションを行なった。a)収益一定・リスク最小化、b)リスク一定・収益最大化、c)効用最大化、d)リスク最小化、e)インデックス+ α の収益を目指す、f)シャープ測度最大化、という6つの戦略をたて、各々について分析を行ない、その結果を示し検討した。

(2)「確率分布アプローチによる株価変動方程式の研究」海蔵寺大成（東京大学 経済学部）

実際の株式市場で観察される株価変動を簡単な確率モデルを用いて説明した。株価変動は株式が売買される過程で発生する市場の需給不均衡によって作り出されると考え、それを株価の値動きを示す株価変動指数と経済の基礎的要因で表現し、平均株価変動指数方程式を導出した。この平均株価変動指数方程式を用いて、最近の株式相場の動き、特に景気循環と株価変動の関係、株価のランダムウォーク（カオスの動き）、バブル、クラッシュ（株価の暴落）などの現象をコンピュータ・シミュレーションの結果にもとづいて解説した。

●人間的グローバル経営システム●

●第12回

日時：3月7日(土)14:00~17:00 出席者：8名

場所：東京都勤労福祉会館（中央区新富）

テーマと講師：「グローバル経営に伴う異文化への対応」上田亀之助(上田イノベーション研究所・杉野女子大学)

ボーダレスでグローバルな変化の急速に進む現在では国内企業の経営にもグローバルな影響が大になりつつあります。したがって、常に異文化への対応が考慮されなければなりません。万差億別のモノゴトに対処するには、どうしても最大公約数的な考えが必要です。

●待ち行列●

●第80回

日時：3月21日(土)14:00~16:30 出席者：19名

場所：東京工業大学（大岡山）情報科学科会議室

テーマと講師：

(1)「優先権付き即時・待時混合システムの解析」牛志升，秋丸春夫（豊橋技術科学大学）

B-ISDN (Broadband Integrated Services Digital Network) システムから抽出した標記モデルを提案した。位相マルコフ再生入力，位相型サービス分布を仮定し，行列幾何的解法により所要の評価尺度を求めた。

(2)「Covariance Structure of Interrupted Markov Modulated Poisson Process」町原文明（NTT通信網総合研究所）

通信網におけるさまざまな入力過程を記述する断続マルコフ変調過程を提案し，その生起間隔の共分散構造に関して論じた。本過程は既存の断続ポアソン過程 (IPP)，マルコフ変調過程 (MMP) を特殊な場合として含む。