

平成9年度支部総会報告(Ⅱ)

中部支部

日 時：平成9年3月15日(土)

議 題：

1. 平成8年度事業報告

- 1) 総会 平成8年3月16日
- 2) 運営委員会……1回
- 3) 幹事会……4回
- 4) 支部研究発表会……1回
- 5) 研究会……5回
- 6) 講演会……1回
- 7) 見学会……1回
- 8) 支部ニュース……9回

支部研究発表会アブストラクト集

2. 平成8年度決算

自) 平成8年3月1日 至) 平成9年2月28日 (単位：円)

	子 算	決 算
収入合計	628,150	618,364
支出合計	638,907	629,037
当期運営残高	△ 10,757	△ 10,673
前期繰越金	10,757	10,757
次期繰越金	0	84

3. 平成9年度事業計画

- 1) 総会……1回
- 2) 運営委員会……1～2回
- 3) 幹事会……数回
- 4) 支部研究発表会……1回
- 5) 定例講演会……1回
- 6) 講演会……1回
- 7) 事例研究会……1回
- 8) 研究会……6～7回
- 9) 見学会…1～2回
- 10) 支部ニュース……3～4回
- 11) 創立40周年記念支部記念シンポジウム

4. 平成9年度予算

自) 平成9年3月1日 至) 平成10年2月28日 (単位：円)

科 目	金 額	科 目	金 額
(収入の部)		(支出の部)	
合 計	621,504	合 計	621,504

5. 平成9年度支部役員

- 支 部 長 小谷重徳 (トヨタ自動車)
 副 支 部 長 中川覃夫 (愛知工業大学)
 運 営 委 員 安達公一 (名古屋工業大学) 飯田次生 (日本ガイシ) 岩田 怜 (名鉄コンピュータサービス) 大野勝久 (名古屋工業大学) 大鑄史男 (名古屋工業大学) 菊田健作 (富山大学) 久野源三 (中部電力) 鈴木敦夫 (南山大学) 玉置光司 (愛知大学) 辻 紘良 (愛知淑徳大学) 中田友一 (中京大学) 中村正治 (名古屋銀行) 日比野康文 (愛知学院大学)
- 監 事 田中庸平 (中電コンピューターサービス) 沢木勝茂 (南山大学)
- 幹 事 金子美博 (岐阜大学) 中出康一 (名古屋工業大学) 向井友章 (トヨタ自動車) 内藤 博 (中部電力)
- 顧 問 小野勝次 (名古屋大学名誉教授)

東北支部

日 時：平成9年5月28日(水)

議 題：

1. 平成8年度事業報告

- 1) 総会 平成8年5月21日
- 2) 運営委員会……1回
- 3) 幹事会……1回
- 4) 講演会……1回
- 5) 研究会……1回

2. 平成8年度決算

1) 貸借対照表 (平成9年2月28日現在) (単位：円)

借 方		貸 方	
科 目	金 額	科 目	金 額
預貯金	164,831	当期収支差額	164,831
合 計	164,831	合 計	164,831

2) 収支計算書 (平成8年3月1日～平成9年2月28日)
(単位:円)

科 目	予 算 金 額	決 算 金 額
収 入 合 計	371,266	389,121
支 出 合 計	371,266	224,290
当期収支差額	—	164,831
次期繰越金	—	164,831

3. 平成9年度事業計画

- 1) 総会……1回
- 2) 運営委員会……1回
- 3) 幹事会……1回
- 4) 講演会……1回
- 5) 研究会……1回
- 6) 創立40周年記念支部記念シンポジウム

4. 平成9年度予算

(平成9年3月1日～平成10年2月28日) (単位:円)

科 目	予算金額	前年決算	増 減
収 入 合 計	503,721	389,121	114,600
支 出 合 計	503,721	224,290	279,431

5. 平成9年度支部役員

- 支 部 長 松田 泰 (東北電力)
 副 支 部 長 石川明彦 (岩手大学) 山本 保 (東北コンピュータ・サービス)
 運 営 委 員 鈴木義也 (東北大学) 関田康慶 (東北大学)
 渡利千波 (東北学院大学) 竹内 清 (石巻専修大学) 岩田恒一 (石巻専修大学) 手島恒男 (青森公立大学) 田中謙輔 (新潟大学) 御園生善尚 (東北大学名誉教授) 後藤義雄 (河北新報社友) 千葉雅保 (河合塾文理学院) 盛岡宏章 (日本IBM) 鈴木宏輔 (アステル東北) 中館勝栄 (通研電気工業) 福山年昭 (東北コンピュータ・サービス) 松坂吉章 (NTT東北支社) 黒井光男 (東北電力)
 監 事 神 正照 (東北工業大学) 原田 孜 (東北コンピュータ・サービス)
 幹 事 木谷 忍 (東北大学) 増田 聡 (東北大学) 安田一彦 (東北大学) 岡田正巳 (東北大学) 谷内正文 (東北学院大学) 鈴木康彦 (福島大学) 中山 明 (福島大学) 山田孝子 (山形大学) 古藤 浩 (東北芸術工科大学) 吉岡良雄 (弘前大学) 瀬戸口良三 (帝京大学) 熊本義信 (日本IBM) 上野博英 (SRA 東北) 只野徹 (富士通東北システムエンジニアリング)

赤間長浩 (NTT東北支社) 笹村莞治 (東北電力) 丸山 真 (東北電力)

顧 問 遠藤市彌 (東北発電工業) 和田秀三 (東北大学) 小川 久 (山形大学名誉教授) 御園生善尚 (東北大学名誉教授) 竹内 清 (石巻専修大学) 齋藤 浩 (東日本興業) 中澤博司 (ユアテック) 幕田圭一 (東北電力) 奈良 久 (青森公立大学) 高橋幸雄 (東京工業大学) 佐藤晃郎 (東北電力) 武藤滋夫 (東京都立大学)

北海道支部

日 時:平成9年3月27日(木)

議 題:

1. 平成8年度事業報告

- 1) 総会 平成8年3月9日
- 2) 運営委員会……3回
- 3) 平成8年度春季研究発表会
- 4) 第35回シンポジウム
- 5) 講演会……2回
- 6) OR企業サロンの共催
- 7) 情報処理北海道シンポジウム'96の後援

2. 平成8年度決算

1) 貸借対照表 (平成9年2月28日現在) (単位:円)

借 方		貸 方	
科 目	金 額	科 目	金 額
現 金	146,557	前期繰越	658,201
預 金	633,066	当期運営残高	121,422
合 計	779,623	合 計	779,623

2) 収支計算書

自)平成8年3月1日 至)平成9年2月28日 (単価:円)

科 目	予 算 額	決 算 額
(収入の部)		
本部交付金	275,500	275,500
参加費	75,000	75,000
利息収入	—	527
合 計	—	351,027
(支出の部)		
合 計		229,605
当期運営残高	—	121,422
前期繰越金	—	658,201
次期繰越金	—	779,623

3. 平成9年度事業計画

- 1) 総会……1回
- 2) 運営委員会……2～3回
- 3) 学会創立40周年・支部創立35周年記念シンポジウム
- 4) 講演会ならびに研究会
- 5) 普及活動

4. 平成9年度予算案

自) 平成9年3月1日 至) 平成10年2月28日 (単位: 円)

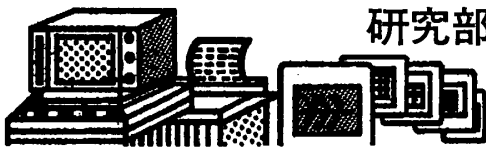
収 入		支 出	
科 目	金 額	科 目	金 額
収入合計	1,130,123	支出合計	1,130,123

5. 平成9年度支部役員

支 部 長 戸井田 弘 (北海道電力)
 副 支 部 長 大内 東 (北海道大学)
 運 営 委 員 木村俊一 (北海道大学) 佐藤馨一 (北海道大学) 関口恭毅 (北海道大学) 長谷川淳 (北海道大学)

道大学) 山村悦夫 (北海道大学) 加地太一 (小樽商科大学) 中村隆志 (小樽商科大学) 行方常幸 (小樽商科大学) 若林信夫 (小樽商科大学) 久保 洋 (室蘭工業大学) 今 尚之 (北海道教育大学) 大柳俊夫 (札幌医科大学) 伊藤正義 (北海道工業大学) 大堀隆文 (北海道工業大学) 千葉博正 (札幌大学) 北川正彦 (札幌市) 長津行高 (共和コンクリート) 加賀屋誠一 (北海道大学)

監 事 元谷靖宏 (日本ユニシス)
 幹 事 山本雅人 (北海道大学) 高野伸栄 (北海道大学) 福居文継 (北海道電力) 岩坂嘉明 (北海道電力)
 顧 問 戸田一夫 (北海道電力(株)取締役会長) 三浦良一 (北海道大学名誉教授) 加地郁夫 (北海道大学名誉教授) 浅利英吉 (北海道文理科短期大学) 五十嵐日出夫 (北海道大学名誉教授) 河口至商 (北海道大学名誉教授) 沼田 久 (小樽商科大学名誉教授)



研究部会報告

●理財工学●

・第1回

日 時: 4月25日(金) 19:00~21:00

出席者: 35名

場 所: 東京工業大学南4号館6F

テーマと講師:

(1) 「企業財務から見た年金資産運用」

浅野 幸弘 (住友信託銀行)

年金の運用リスクは企業が負っており、そのため運用政策は、企業価値の観点から決定されるべきであることを主張した。また、年金運用のための目的関数の形状、情報開示の重要性、規制の問題についても論じた。

(2) 「多期間ダウンサイドリスクフレームワークと年金資産運用」

竹原 均 (筑波大学社会工学系)

企業年金を、多期間アセットアロケーション問題としてとらえ、全体的なシステムとして構築する手法

を提案した。これらのシステムにおける推定の問題、最適化の問題、評価の問題等について、実際の数値実験を踏まえて論じた。

・第2回

日 時: 5月23日(金) 19:00~21:00

出席者: 80名

場 所: 東京工業大学南4号館6F

テーマと講師:

(1) 「数学的危機論を考慮した信用リスクの計量化とその応用——JP MorganのCredit Metricsとの比較——」

鈴木 茂央 (日興証券・投資工学研究所)

信用リスクをデフォルトに起因する経済的損失とその変動性とみなして評価を行った。信用リスクのポートフォリオや、推定誤差の影響を考察した上で、実際の格付情報に基づいた計算結果を示した。

(2) 「信用リスクの数量化とプライシング」

王 京穂, 佐上 啓 (日本興業銀行)

デフォルトの発生を偶発的なイベントとしてとらえて、信用リスクの構造をハザードモデルを用いて表現した。このモデルに基づいて、社債の評価を行う方法を提案した。

・第3回

日 時: 6月27日(金) 18:00~21:00