

日 時：平成 9 年10月24日(金) 19:00~21:00

出席者：70名

場 所：東京工業大学南 4 号館 6 F

テーマと講師：

(1) 「low-discrepancy sequence の比較-デリバティブプライシングに適用した場合-」

二宮 祥一 (日本 IBM・東京基礎研究所)

モンテカルロシミュレーションのための乱数発生機構に関して、(t, m, s)-nets および (t, s)-sequence の構築について論じた。既存の sequence の問題点を指摘した後、その改良の方向についていくつかの側面から論じた。

(2) 「デリバティブ業務におけるモンテカルロ・シミュレーション適用の実際」

安藤雅一・時岡毅美 (日本興業銀行・フィナンシャルエンジニアリング部)

モンテカルロシミュレーションによるデリバティブの評価のシステムについて、実務的な立場から紹介を行った。同グループが開発した Low Discrepancy Sequence および並列計算の手法について、数値例を用いた説明がなされた。

●ファジィ動的計画法●

日 時：平成 9 年10月27日(月) 18:00~20:00

場 所：EDC ビル

テーマと講師：

「Controlled Markov Set-Chains について」

歳野 正美 (千葉大学)

動的システムの最適化問題において、いくつかのパラメータが確定できない場合、パラメータの存在する範囲を見積もり、ある種の基準のもとで最適解を見出す方法が考えられる。この考え方を有限状態マルコフ決定過程で推移確率法則が確定できない場合に適用する。

推移確率行列の範囲を凸多面体で見積もった時、割引された総期待利得の集合が有界閉区間になることを示し、ミニマックス基準によって閉区間の左側端点および右側端点の DP による最適方程式を導き、最適政策の存在とそのアルゴリズムを与えている。

●イノベーション●

・第18回

日 時：平成 9 年11月 8 日(土) 14:00~17:00

出席者：8名

場 所：中央区新富 ワーカーズ・サポートセンター

テーマと講師：「15世紀の王陽明、21世紀の陽明学」

上田 亀之助

今から500年昔に出現した傑出した人材である王陽明は陽明学の創始者であり、優秀な行政官であり、明代に最高の軍功をたてた軍司令官でした。陽明学はソフトテクノロジーであり、ソフトなシステム分析であり、複雑で多岐にわたるようなオペレーションの解析や、探究や、実行に、そして平成の壁の打破に役に立ちます。

会 合 記 録

11月 6 日 (木)	企業サロン企画委員会	3名
11月10日 (月)	機関誌編集委員会	10名
〃	国際委員会	5名
11月12日 (水)	会員増強委員会	5名
11月13日 (木)	研究普及委員会	6名
11月17日 (月)	庶務幹事会	6名
11月20日 (木)	理事会	11名

第 4 回理事会議題 (9—11—20)

平成 9 年度第 3 回理事会議事録の件
入退会承認の件
賛助会員勧誘協力依頼の件
平成10年度事業計画 (案) 及び予算 (案) 提出依頼の件
平成 9 年度第 1 回 OR セミナー収支予算 (案) の件
第41回シンポジウム及び平成11年度春季研究発表会の件

学会事務局年末年始休業のお知らせ

平成 9 年12月29日(月)~平成10年 1 月 6 日(火)