



研究部会報告

●イノベーション●

・第25回

日時：6月6日(土) 14:00~17:00

出席者：9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：「今の日本はどこをどう改善したらよいか」 上田亀之助

モノゴトが平穏無事ですと、安逸に慣れて、つい改善を怠ってしまいがちです。するとシステムの中のエントロピー（駄目さ）が高くなり駄目になってしまいます。平成10年の日本の政治・経済の現状はまさにそれです。エントロピーを早急に捨てなければなりません。

・第26回

日時：7月4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：「今の日本はどこをどう改善したらよいか？ 第2回」 上田亀之助

日本のように平穏無事が長く続く国では、どうしてもつい、改善を忘れがちになりますので、政治・経済・社会・教育等のあらゆる分野でエントロピーが高くなならないように常に細かい変動にも注目してそれに対応する改善を怠らないようにしなければなりません。

●平成10年度会費納入のお願い(事務局)

平成10年度の会費につきましては、すでに請求書をお送りさせていただいておりますが、未納の方はお早めにご送金くださるようお願いいたします。なお、9年度の会費につきましても未納の方は合わせてお支払いくださるようお願いいたします。

〔預金口座振替ご利用の方へ〕

平成10年度から預金口座振替をご希望の正会員の方は、学会事務局までTEL, FAX, 郵便にてご連絡ください。折り返し預金口座振替依頼書をお送りいたします。

●理財工学●

・第12回

日時：6月26日(金) 19:00~21:00

出席者：62名

場所：東京工業大学南4号館6F 677号室

テーマと講師：

(1)「オープン型投資信託のパフォーマンス評価について」

Part I. ダイリジョン効果のパフォーマンスへの影響

Part II. 動的ポートフォリオ戦略を考慮したスタイル分析

竹原 均 (筑波大学社会工学系)

本発表では、オープン型投資信託におけるダイリジョン効果の影響を取り上げ、これがパフォーマンス評価に与える影響について考察した。そして、ダイリジョン効果の影響は、特定のファンドに関しては著しく大きいことが、全体のパフォーマンスを説明可能なほど大きくないことを示した。さらに、Sharpeの方法を拡張したDSA (Dynamic Style Analysis) を提案し、これがアルゴリズムの取束性や計算時間の観点からも優れていることを示した。

(2)「社債ポートフォリオの信用リスク評価と実証分析」 鈴木茂央 (日興証券投資工学研究所)

本発表では、社債ポートフォリオに対して特性を考慮した信用リスクの評価問題について分析を行った。まず、信用リスクとしてデフォルトによる価値の低減、スプレッド変化による社債価格変化を考慮し、関連も考慮した社債ポートフォリオの評価を行った。ついで、このモデルを用いて実証分析を行い、その結果に関する考察を行った。

会員名簿発行について

本年11月末を目標に、「会員名簿」を3年ぶりに刊行することとなりました。会員の皆様方には、原簿の訂正作業、広告主の紹介など、多大のご協力、ご支援をいただきたいと考えております。

皆様のお手元に置いていただいで頻繁にご利用いただけるような名簿作成をめざしたいと存じますので、よろしくお願ひします。

名簿刊行委員長 上田 徹

●待ち行列●

・第137回

日 時：7月18日(土) 14:00~16:30

出席者：23名

場 所：東京工業大学 本館1-94号室

テーマと講師：

(1)「時間指定通信におけるリソース管理に関する諸問題」 横谷哲也 (三菱電機)

情報通信ネットワークにおける時間指定通信の必要性について説明するとともに、実現にあたって生じる通信帯域やコネクション識別子などのリソース管理に関する問題点について解説を行った。特に、時間指定通信では即時系通信に比べて高速なCAC (call admission control) アルゴリズムが要求されること、即時系通信の受付制御において保留時間の推定が必要であることを指摘し、これらの問題に関する最近の研究状況を紹介した。

(2)「F-netにおけるルーティング方式とその性能評価」 大原久樹, 高橋敬隆 (NTT)

ファクシミリ通信網においては、ノードの混雑状況に応じて動的ルーティング制御を行う必要がある。本発表では、効率的なルーティング方式を求めるための基礎的なモデルとして、2本の有限容量待ち行列にそ

れぞれ集団到着があり、溢れた呼はもう一方の待ち行列で処理されるモデルを考え、状態依存の拡散近似法を用いた系内呼数分布の評価方法を提案した。また、シミュレーション結果との比較によって、近似解法の性質を調べるとともに精度の検証を行った。

会 合 記 録

7月8日(水)	機関誌編集委員会	3名
7月16日(木)	研究普及委員会	9名
7月23日(木)	理事会	12名

第2回理事会議題 (10—7—23)

- 平成10年度第1回理事会議事録の件
- 平成10年度春季支部長会議議事録の件
- 入退会承認の件
- 中国・四国支部規約改正の件
- 第1・四半期収支報告(含40周年特別会計)の件
- 第39回シンポジウム並びに平成10年度春季研究発表会終了報告及び決算報告の件
- 平成10年度秋季研究発表会予算案及び特別講演の件
- 企業事例交流会(第2回)開催の件
- 企業フォーラム開催の件
- テクノOR講座開催の件

平成10年度役員・支部長名簿

理事 会 長	水野 幸男 (日本電気)	理事 無 任 所	石井 博昭 (大阪大学)
〃 副 会 長	小金澤章吾 (JR 西日本開発)	〃 〃	畑 昭彦 (日本電気)
〃 〃	今野 浩 (東京工業大学)	〃 〃	八 卷 直一 (静岡大学)
〃 〃	茨木 俊秀 (京都大学)	〃 監 事	岡本 行二 (東芝情報システム)
〃 庶 務	上田 徹 (成蹊大学)	〃 〃	高 森 寛 (青山学院大学)
〃 〃	中野 一夫 (構造計画研究所)	支 部 長	
〃 会 計	岡本 吉晴 (三菱総合研究所)	北海道支部長	戸井田 弘 (北海道電力)
〃 研究普及	中森真理雄 (東京農工大学)	東北支部長	山本 保 (東北コンピュータ・サービス)
〃 〃	常盤晋吾 (オートメーション・リサーチ・コーポレーション)	中部支部長	中川 覃夫 (愛知工業大学)
〃 編 集	大山 達雄 (政策研究大学院大学)	関西支部長	田村 坦之 (大阪大学)
〃 〃	森戸 晋 (早稲田大学)	中・四国支部長	河合 一 (鳥取大学)
〃 国 際	高橋 幸雄 (東京工業大学)	九州支部長	時永 祥三 (九州大学)
〃 無 任 所	石川 明彦 (岩手大学)		