



研究部会報告

●システムの最適化と OR ●

日 時：9月18日(金) 14:30~17:00

出席者：16名

場 所：金沢大学経済学部会議室

テーマと講師：

(1)「提携構造がある場合のシャープレイ値とその応用について」 小野理恵(富山大学経済学部)

予めプレーヤーの提携構造が決まっている状況に拡張したシャープレイ値と、それをもとに提携構造の安定性をいかに表わすかを解説した。また応用例として1993年以降の日本の衆議院の勢力をもとにしたパワーと実際に形成された連立政権との間に関連があるかどうかを議論した。

(2)「ファジィ数の順序関係から多目的の順序関係へ」 古川長太(創価大学工学部)

目的関数の値がファジィ数で与えられる最小化問題を、ファジィ・マックス順序に関して解こうとすると、この順序が全順序ではないために真の意味の最小解が存在することは極めて稀で、通常は互いに非支配的な沢山の解が存在する。このため、ファジィ数の間にパラメトリックな2種類の順序関係を導入し、これら2種類を基準として最小化を試みることにより、互いに非支配的な解の殆ど全てが検出されることを示した。

●理財工学●

・第14回

日 時：9月25日(金) 19:00~21:00

出席者：85名

場 所：東京工業大学 百周年記念館3階フェライト会議室

テーマと講師：

(1)「クレジット・デフォルト・スワップの評価モデル」 青沼君明(東京三菱銀行, 東京大学), 中川秀敏(東京大学)

クレジット・デリバティブ・スワップの評価では、企業のデフォルトをハザード・プロセスとしていかに取り込むかという問題がある。講演では、Vasicek タ

イプのハザード・プロセスを中心に、クレジット・デフォルト・スワップの評価モデルと、それらのパラメータ推定法についての説明があった。

(2)「Jarrow-Turnbull Modelによるクレジットデリバティブの評価」 白川 浩(東京工業大学)

Jarrow-Turnbull Modelにおいて、デフォルトリスクのリスクプレミアムが時間に対し確定的な関数となる場合のモデルについて考察した。結果として無裁定条件と両立する割引債の額面価格回収率の関数は、ある種の変微分方程式を満たし、無裁定条件と両立するためには、デフォルトフリー債権とのスプレッドが、デフォルトするまでは、一定のままでなければならないことを示した。

●イノベーション●

・第28回

日 時：10月3日(土) 14:00~17:00

出席者：8名

場 所：中央区新富ワークス・サポートセンター

テーマと講師：「孔子の『論語』とグローバルな21世紀」 上田亀之助

春秋戦国時代の孔子の『論語』は二千年以上経った現在でもよく読まれています。その主張する所は社会的人間のあり方と国家の政治・経済にかかわる道徳思想で、良い人間関係の仁と忠恕(思いやり)がその中心概念でグローバルな時代向きです。

●ファジィ動的計画法●

日 時：10月5日(月) 18:00~20:00

場 所：日科技連

テーマと講師：「Dynamic Programming in the Mixed Type Secretary Problem」 坂口 実

n 人の候補者の中から1人の秘書を採用したい。ランダムな順序で1人ずつ順にテストする。その成績が2次元 r, v 列 $(X_i, Y_i) i=1, 2, \dots, n$ で表わされる。 X_i (Y_i)は候補者 i の労力(容姿)を評価する。 $\{X_i\}$ については Full-information, $\{Y_i\}$ については No-information のときの mixed-type secretary problem を提示し、これを DP により解を与える。

●21世紀における交通・流通システム●

・第6回

日 時：10月16日(金) 18:00~20:00

出席者：6名

場 所：東洋経済新報社ビル（日本橋）

テーマと講師：「旅客流を考慮した列車制御シミュレーション」

平井 力（財団法人鉄道総合技術研究所）

各列車・各駅の旅客情報が、動改札機の技術革新やスマートカードの導入などにより利用可能となる将来、列車運行に乱れが生じたとき、一部の列車に混雑集中しないような時隔調整アルゴリズムの紹介とシミュレーション結果の報告があった。

会員名簿刊行のお知らせ

（事務局）

1998年版の会員名簿（**会員限定**）が発刊されました。E-mail addressも登録され、3年振りの改定版です。まだ残部がありますので、購入ご希望の**会員**の方には、1冊4,000円でおわけいたします。FAXもしくはハガキでお申込みください。（消費税は非課税です）

氏名・会員番号・代金支払方法（振込でお願いいたしますが、請求書等必要の有無など）をご記入ください。

会 合 記 録

10月8日（木）	機関誌編集委員会	6名
10月9日（金）	国際委員会	4名
10月16日（金）	研究普及委員会	13名
	論文誌編集委員会	12名

●平成11年度会費納入のお願い（事務局）

平成11年度の会費請求書をお送りいたしましたので、お早めにご送金くださるようお願いいたします。なお、10年度以前の会費を未納の方は合わせてお支払いくださるよう重ねてお願いいたします。

〔預金口座振替ご利用の方へ〕

平成11年度会費振替は平成11年1月20日（木）になります。振替金額の不足のないよう、預金残高をご確認いただければ幸いです。

なお、平成11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。

査読者へのお礼

今年度のOR誌の論文・研究レポート、論文・事例研究、論文・総合報告の査読を次の方々をお願い致しました。

ご協力いただきましてありがとうございました。この場を借りて厚くお礼を申し上げます。

（機関誌編集委員会）

上田 徹，内山義英，大屋隆生，岸本一男，北村美香，木下栄蔵，國澤直樹，榎藤 元，逆瀬川浩孝，椎名孝之，篠原正明，新村秀一，住田 潮，高井英造，高橋磐郎，高橋幸雄，徳山博子，西岡靖之，西尾チヅル，枇々木規雄，前川俊一，村松健児，守口剛，八巻直一，山田善靖，若山邦紘，和多田淳三

（敬称略）