



研究部会報告

●21世紀における交通・流通システム●

・第7回

日 時：平成10年11月20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：「超伝導磁気浮上式鉄道の開発状況」
鶴賀仁史(JR東海旅客鉄道株式会社)

21世紀の高速輸送システムとして期待されている超伝導磁気浮上式鉄道の開発状況について説明があり、その後、建設費用から保守費用まで含めたトータル・コストを従来の高速鉄道と比較した議論などが活発に行われた。

●理財工学●

・第15回

日 時：平成10年11月27日(金) 18:30~20:30

出席者：46名

場 所：東京工業大学 石川台1号館7階754号室

テーマと講師：

(1)「推定リスクを考慮したポートフォリオ戦略」

鹿島浩之氏(興銀フィナンシャルテクノロジー、東京工業大学大学院社会理工学研究科)

本研究では、推定リスクを考慮したポートフォリオ戦略の導出、および、ポートフォリオ戦略にあった推定量(予測モデル)評価基準を提示した。そして、これらの議論から、ポートフォリオ戦略に主観的情報の有効利用が可能となることを示した。

(2)「我が国株価指数先物取引市場における値幅制限規制のMCMCベイズ分析」

高山俊則氏(MTBインベストメントテクノロジー研究所)

本研究では、わが国の株価指数先物取引市場における値幅制限規制の評価を行うために、値幅制限規制の計量モデルを提案した。そして、わが国の株価指数先物データをこのモデルに適用した。その結果、値幅制限規制が真の収益率に対して非対称なインパクトを与えたことを示した。

●システムの最適化とOR●

・第8回

日 時：平成10年11月28日(土) 14:30~17:00

出席者：25名

場 所：福井工業大学2号館420会議場

テーマと講師：

(1)「システム設計の変革とオペレーションズ・リサーチ」 牧野 勝(福井工業大学経営工学科)
本発表では、「3層クライアント・サーバ」方式のシステム設計技術による金融ビッグバン(日本版)のORシミュレーションが提示された。ここで、3層とは、基本層、中間層、応用層であり、基本層に対応して経済界全体のシミュレーション、中間層に対応して金融界のビッグバン・シミュレーション、応用層に対応して個人系の金融管理シミュレーションが実行される。本発表では、本システムの設計が提案された。

(2)「信頼性を考慮したネットワークの最適構成問題へのメタ戦略の応用」

得能 豊(富山県立大学大学院工学研究科修士課程)、高木 昇(富山県立大学)、中島恭一(富山県立大学)

信頼性を考慮したネットワークの最適構成問題に対する効率のよい解法を提案した。本研究では最近注目されている様々なメタ戦略(GA, GLS, SA, TS)を用いた解法について比較検討を行い、ある条件の下でGLSが有効であることを示した。

●イノベーション●

・第30回

日 時：平成10年12月12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：「日本の景気、世界の景気」

上田亀之助

景気という現象は全世界にわたって国の内外を問わず起こっていますが、その生態は未だよく分かっておりません。したがって不況対策も膨大な予算を使いながら何時も試行錯誤の繰り返しです。日本の今回の長期にわたる不況も、皆があなた任せでただ騒いでいるだけの間は回復しません。本気で地道に取り組むしかありません。