

No. 394
2004年
5月

OR学会だより

社団法人 日本オペレーションズ・リサーチ学会
〒113-0032 東京都文京区弥生 2-4-16 学会センタービル 3階
電話(03)3815-3351 代 Fax(03)3815-3352
<http://www.orsj.or.jp/>

● 第52回シンポジウム

日 程：平成16年9月7日(火)
場 所：東北大学川内北キャンパス講義棟
テーマ：「福祉とその周辺」(仮)
実行委員長：中山 明 (福島大)

● 平成16年秋季研究発表会

日 程：9月8日(水)研究発表会, 懇親会
9日(木)研究発表会, 10日(金)見学会(予定)
場 所：東北大学川内北キャンパス講義棟 (仙台市青
葉区川内)

特別テーマ：「ものづくりとOR」
実行委員長：石川明彦 (岩手大学)
発表申込締切：郵送の場合：6月25日(金)

電子メールの場合：7月2日(金)
申込書およびアブストラクト送付先：

〒980-8576 仙台市青葉区川内
東北大学大学院経済学研究科
鈴木 賢一

Tel/Fax.022(217)6281

問合せ先：

E-mail: or2004f@dais.is.tohoku.ac.jp

※発表申込の詳細は東北支部のHPにてご案内致します。

http://rizaikohgaku.com/tohoku_or/index.html

● 平成16年度第1回ORセミナー

「ルーエンバーガーの『金融工学入門』で学ぶ金融工学の基礎」

日 程：6月10日(木) 9:15~17:30
会 場：(株)構造計画研究所 本所新館 (〒164-0011
東京都中野区中央4-5-3 <http://www.kke.co.jp/map/tokyo.html>)

開催趣旨：

投資信託や年金基金などの資産運用, 派生証券(デリバティブズ)の価格付け, 市場リスクや信用リスクの管理など, 金融工学を用いた技術は金融実務において広く使われています。一方, 近年では一般企業にお

いても天候デリバティブズ等を用いた事業リスクの管理など金融工学の技術は広く適用され, ますます金融工学の重要性が高まりつつあります。新しく創造的な金融ビジネスを行うには最新理論を学ぶことも必要ですが, それ以前に金利理論, ポートフォリオ理論, 派生証券理論といった金融工学の基礎をバランスよく学んでいることが必須です。

本セミナーは, バランスの取れた金融工学の教科書として定評のある『金融工学入門』(*)を使い, 翻訳者によるリレー講義(担当箇所は翻訳を担当したところ)で金融工学の基礎を学びます。600ページを越える本ですので, 全部を詳細に説明するのは無理ですが, 細かいテクニックはあとで本を読んでもらうことを前提にして, 全体像をつかんでもらうとともに, 重要な項目を重点的に解説します。

(*) ルーエンバーガー著, 今野浩, 鈴木賢一, 枇々木規雄訳, 『金融工学入門』日本経済新聞社, 2002, 4800円(原著: Luenberger, Investment Science, Oxford University Press, 1997)。

対象：

- ・金融機関・一般企業に勤めていて金融工学を勉強する必要がある方
- ・金融工学を勉強しようと思っているが, 何から始めてよいか分からない方
- ・金融工学の全体像をつかむとともにその基礎を学びたい方
- ・金融工学をひとつお勉強したが, 重要なポイントを再確認したい方
- ・新入社員, 学生等

プログラム：

- (1) 9:15~9:30 「金融工学の概要」
枇々木規雄 (慶應義塾大学助教授)
『金融工学入門』で学ぶことができる金融工学の基礎を概説する。
- (2) 9:30~11:30
「第1部 確定的なキャッシュ・フロー流れ」
枇々木規雄 (慶應義塾大学助教授)
第2章: 基本的な金利理論 (割引率, 現在価値, 内部収益率)

第3章：確定利付証券（価格式，満期利回り，デュレーション，コンベキシティ）

第4章：金利の期間構造（イールド・カーブ，スポットレート，フォワードレート）

第5章：応用金利分析（資本予算，最適ポートフォリオ，動的モデル，配当割引モデル）

(3) 12:45~14:15

「第2部 一期間確率的キャッシュ・フロー」

今野 浩（中央大学教授）

第6章：平均-分散ポートフォリオ理論（分散化，効率的フロンティア，マーコビッツモデル）

第7章：資本資産価格付けモデル（CAPM，資本市場線，証券市場線）

第8章：モデルとデータ（ファクターモデル，無裁定価格付けモデル）

第9章：一般原理（効用関数，リスク回避，状態価格）

(4) 15:00~17:30 「第3部 派生証券」

鈴木賢一（東北大学助教授）

第10章：先渡，先物，スワップ

第11章：資産ダイナミクスのモデル（2項格子モデル，ウィナー過程，伊藤の定理）

第12章：基本的なオプション理論（コールオプション，プットオプション，リアルオプション）

第13章：オプションについての追加事項（ブラック・ショールズ方程式，リスク中立評価法）

第14章：金利派生証券（債券，モーゲージ，2項格子アプローチ，金利変動モデル）

参加費：正・賛助会員 25,000円，非会員 30,000円（テキスト（書籍「金融工学入門」日本経済新聞社）代込み，正賛助・非会員についてはテキスト持参による割引なし），学生会員 8,000円（書籍「金融工学入門」を既にお持ちでセミナーに持参する方は5,000円）

※正・賛助会員および非会員のセミナー参加者への特典として，参加日より1年間有効なセミナー無料参加券（本人のみ有効）を呈いたします。

申込み先：

㈱日本オペレーションズ・リサーチ学会事務局

Tel.03(3815)3351 Fax.03(3815)3352

E-mail: kenkyu@orsj.or.jp

*6月4日(金)までに学会事務局へE-mailまたはFAXにて。

●国際会議案内

・「EURO XX」

ヨーロッパ地域の国際OR学会連合EURO (the Association of European Operational Research Societies) が開催しているEURO国際会議が20回記念大会 (20th European Conference on Operational Research) となりました。今回はギリシアOR学会がホスト国となり，神話の島ロードス島で開催です。皆様の積極的なご参加をお願いいたします。

日 程：2004年7月4日~7日

場 所：Rhodes, Greece

テーマ：OR and the management of electronic services

主 催：ギリシアOR学会 (HELORS)

問合せ先：ysiskos@unipi.gr

*詳しくは，www.Euro-rhodes2004.orgをご覧ください。

●第20回FMES・研連シンポジウムのご案内

『経営戦略とリスクマネジメント』

日 時：2004年7月9日(金) 13:30~18:00

場 所：日本学術会議講堂（〒106-8555東京都港区六本木7-22-34）

Tel.03(3403)6291（代表）

（営団地下鉄千代田線「乃木坂」駅下車，青山霊園方面出口（出口5番）より徒歩1分）

共 催：日本学術会議経営管理工学専門委員会，日本学術会議経営工学研究連絡委員会，(社)日本経営工学会，(社)日本品質管理学会，日本開発工学会，日本信頼性学会，研究・技術計画学会，日本設備管理学会，経営情報学会，プロジェクトマネジメント学会，(社)日本オペレーションズ・リサーチ学会（順不同）

資料代：5,000円（学生2,000円）資料代は開催当日受付にてお支払いください。

申込み先：〒113-0032

東京都文京区弥生2-4-16 学会センタービル3F

(社)日本オペレーションズ・リサーチ学会 事務局

「第20回FMES・研連シンポジウム係」

Tel.03(3815)3351 Fax.03(3815)3352

E-mail: jimukyoku@orsj.or.jp

多数の方のご参加をお待ち申し上げます。

●平成16年度研究部会・グループの新設・
継続申請の審査について

(研究普及委員会)

先に募集を行いました平成16年度研究部会・グループの新設および、継続に関しまして、今回も多数の

申請書が提出されました。研究活動の公開性、実績等に照らして審査を行いました結果、以下の研究部会・研究グループを設定致しました(☆印は新設)。

参加ご希望の方は、各部会・グループの主査または幹事までご連絡下さい。

平成16年度常設研究部会

	常設部会名	主 査	幹 事
1	待ち行列	山下 英明 (東京都立大学) 0426-77-2326 hideak@comp.metro-u.ac.jp	藤本 衡 (東京電機大学) 0492-96-2991 内線 2306 fujimoto@j.dendai.ac.jp
2	OR/MSとシステム・マネジメント	六十里 繁 (千葉商科大学) 048-769-9579 musorishi@nifty.com	田中 宏和 (神奈川工科大学) 046-291-3203 tanaka@ic.kanagawa-it.ac.jp
3	数理計画 (RAMP)	福島 雅夫 (京都大学) 075-753-5519 fuku@i.kyoto-u.ac.jp	山下 信雄 (京都大学) 075-753-4759 nobuo@amp.i.kyoto-u.ac.jp
4	統合オペレーション	梅沢 豊 (大東文化大学) 03-3815-0282 umesawa@ic.daito.ac.jp	中野 一夫 (楸構造計画研究所) 03-5342-1024 knakano@kke.co.jp
5	評価のOR	刀根 薫 (政策研究大学院大学) 03-3341-0438 tone@grips.ac.jp	篠原 正明 (日本大学) 047-474-2672 m7sinoha@cit.nihon-u.ac.jp

平成16年度研究部会

	部 会 名	主 査	幹 事
1	数理情報工学的意思決定とその応用	吉富 康成 (京都府立大学) 075-703-5432 yoshitomi@kpu.ac.jp	小出 武 (流通科学大学) 078-796-3037 koide@umds.ac.jp
2	不確実性下のモデル分析とその応用	古川 哲也 (九州大学) 092-642-2445 furukawa@en.kyushu-u.ac.jp	時永 祥三 (九州大学) 092-642-2466 tokinaga@en.kyushu-u.ac.jp
3	マーケティング・データ解析	田口 東 (中央大学) 03-3817-1683 taguchi@ise.chuo-u.ac.jp	生田目 崇 (専修大学) 044-911-1209 takashi@isc.senshu-u.ac.jp
4	アルゴリズム	岩田 覚 (東京大学) 03-5841-6931 iwata@mist.i.u-tokyo.ac.jp	武田 朗子 (東京工業大学) 03-5734-2723 takeda@is.titech.ac.jp
5	意思決定とOR	前田 隆 (金沢大学) 076-246-5409 takashim@kenroku.kanazawa-u.ac.jp	桑野 裕昭 (金沢学院大学) 076-229-8939 kuwano@kanazawa-gu.ac.jp
6	ゲームと実験	武藤 滋夫 (東京工業大学) 03-5734-3622 muto@valdes.titech.ac.jp	猪原 健弘 (東京工業大学) 03-5734-3366 inohara@valdes.titech.ac.jp
7	食糧・環境問題とOR	石井 博昭 (大阪大学) 06-6879-7868 ishii@ist.osaka-u.ac.jp	伊藤 健 (流通科学大学) 078-791-4803 takeshi@umds.ac.jp

	部 会 名	主 査	幹 事
☆8	AHPの世界	木下 栄蔵 (名城大学) 0574-69-0143 kinoshit@urban.meijo-u.ac.jp	大屋 隆生 (財電力中央研究所) 03-3480-2111 ohya@criepi.denken.or.jp
☆9	21世紀モノ造りマネジメント	今泉 淳 (東洋大学) 03-3945-7466 jun@prod.mng.toyo.ac.jp	成松 克己 (榊東芝) 044-549-2408 katsumi.narimatsu@toshiba.co.jp
☆10	世界のインフラストラクチャー	栗田 治 (慶應義塾大学) 045-566-1628 kurita@ae.keio.ac.jp	三浦 英俊 (明海大学) 047-355-5120 hmiura@meikai.ac.jp
☆11	不確実性理論の経営科学への応用	蔵野 正美 (千葉大学) 043-251-1111 内線 2669 kurano@faculty.chiba-u.ac.jp	岩村 覚三 (城西大学) 0492-71-7955 kiwamura@math.josai.ac.jp

● 新設研究部会紹介

1. [AHPの世界]

AHP・ANPとその応用(特に応用は他分野にわたる応用例を紹介します)について、研究の推進と情報の交換を行います。理工学、人文社会科学の幅広い分野の方の参加を歓迎します。年5回、奇数月最終火曜日に研究会を開催します。

2. [21世紀モノ造りマネジメント]

製造業を取り巻く環境の激変に伴いその要請が高まっている、製造現場からサプライチェーン全体とといった様々な視点からの次世代マネジメント手法や数値技術の方向性を提唱することを研究の目的としている。

3. [世界のインフラストラクチャー]

国家・地域間の相互依存と対立を背景とし、国や地域を同じ土俵に載せて安全保障を達成するための『大規模インフラストラクチャー』が重要になっている。本研究部会はその可能性や問題点をORの視点から解明していく。

4. [不確実性理論の経営科学への応用]

不確実環境下での経営科学の諸問題に有効なモデルと計算法について多面的な研究を行う。特に、ファジイ理論と確率・統計の内在的関係を明らかにし、人間に優しい最適決定モデルや革新的計算法の開発研究に取り組む。

● 第16回 RAMP シンポジウム

日 程：2004年10月19日(火)、20日(水)

場 所：石川県金沢市 金沢市文化ホール

実行委員長：前田 隆 (金沢大学)

* 事業計画報告から予定日程の修正をいたしました。

ご注意ください。

● 研究部会・グループ開催案内

[待ち行列]

・第178回

日 時：5月15日(土) 14:00~16:30

場 所：東京工業大学西8号館(W)809号室

テーマと講師：

- (1)「多次元空間上の定常なコックス・ショットノイズの上下界と単調性について」
三好直人 (東京工業大学)
- (2)「マルコフ変調される到着とサービス速度をもつ単一サーバ待ち行列」
滝根哲哉 (京都大学)

問合せ先：東京電機大学理工学部情報科学科

藤本 衡 Tel.049(296)2911 (内線2306)

E-mail: fujimoto@j.dendai.ac.jp

[評価のOR]

・第7回

日 時：5月15日(土) 13:30~16:00

場 所：政策研究大学院大学3階教室E

テーマと講師：

- (1)「Local evaluation of separate evaluators in AHP」
高橋磐郎 (筑波大学名誉教授)
- (2)「Dealing with undesirable outputs in DEA」
刀根 薫 (政策研究大学院大学)

問合せ先：日本大学生産工学部数値情報工学科

篠原正明 Tel.047(474)2672

E-mail: m7sinoha@cit.nihon-u.ac.jp

* 詳しくは、<http://shinohara.su.cit.nihon-u.ac.jp>をご覧ください。

〔AHPの世界〕

・第1回

日時：5月25日(火) 14:00~17:00

場所：(財)電力中央研究所大手町第1会議室

(千代田区大手町1-6-1 大手町ビル7階733室)

テーマと講師：

(1)「本研究部会の趣旨とAHPの世界」

木下栄蔵 (名城大学)

(2)「集団AHP」

中西昌武 (名古屋経済大学)

(3)「合意を導く「決め方」の条件」

藤井 聡 (東京工業大学)

問合せ先：大屋隆生 (財)電力中央研究所

Tel.03(3480)2111 Fax.03(5497)0318

E-mail: ohya@criepi.denken.or.jp

〔OR/MSとシステムマネジメント〕

日時：5月29日(土) 15:00~17:00

テーマと講師：「情報技術による括り出し効果と組織
知能」

太田敏澄 (電気通信大学教授)

問合せ先：神奈川工科大学情報工学科 田中宏和

Tel.046(291)3203

E-mail: tanaka@ic.kanagawa-it.ac.jp

● **会合案内**

〔第238回新宿OR研究会〕

日時：5月18日(火) 12:00~13:30

場所：東天紅会議室 (新宿センタービル53F)

テーマ：「世界の電力発電について」

講師：村上省一氏 (新エネルギー財団シニアコン
サルタント)

参加費：3,000円

問合せ先：日本OR学会事務局

〔第239回新宿OR研究会〕

日時：6月15日(火) 12:00~13:30

場所：東天紅会議室 (新宿センタービル53F)

テーマ：「スポーツとOR」

講師：広津信義氏 (国立スポーツセンター研究員)

参加費：3,000円

問合せ先：日本OR学会事務局

● **助成案内**

・トヨタ財団 2004年度研究助成

助成対象分野：多元価値社会の創造に関連するもの

(1)多様な諸文化の相互作用：グローバル、リージョ
ナル、ローカル

(2)社会システムの改革：市民社会の発展をめざして

(3)これからの地球環境と人間生存の可能性

(4)市民社会の時代の科学・技術

助成対象：個人、または共同研究組織

応募締切：5月20日(木)

問合せ先：(財)トヨタ財団

〒163-0437 新宿区西新宿2-1-1 新宿三井ビル37
階 私書箱236号 Tel.03(3344)1701

* 詳しくは、<http://www.toyotafound.or.jp> をご覧
下さい。

● **他学協会案内**

他学会等が主催する大会やシンポジウムで当学会が
協賛しているものについては、原則として主催学会の
会員と同じ費用で参加できますので、皆様奮ってご参
加ください。

・No.04-22 生産システム部門講演会

開催趣旨：製造プロセスからサプライチェーン、ネ
ットワークコラボレーション、ライフサイクル等
の生産システムに関する話題を中心に、研究活動
および生産システム関連技術者の交流の場として
部門講演会を開催いたします。

主催：(社)日本機械学会

日程：6月12日(土)

場所：東洋大学川越キャンパス

問合せ先：貝原俊也 (神戸大学大学院自然科学研究
科)

E-mail: kaihara@cs.kobe-u.ac.jp

* 詳しくは、<http://www.jsme.or.jp/0406120c.htm>
をご覧ください。

・第23回日本シミュレーション学会大会

主催：日本シミュレーション学会

日程：6月16日(水)、17日(木)

場所：早稲田大学理工学部55号館

参加費：8,000円

問合せ先：日本シミュレーション学会事務局 (澤田)

Tel.03(3239)4738 Fax.03(3239)4714

E-mail: simul@pp.iij4u.or.jp

* 詳しくは、<http://www.soc.nii.ac.jp/jsst/> をご覧
ください。

● 公募案内

・青山学院大学理工学部経営システム工学科

募集人数：専任講師・助教授もしくは教授 1名

専門分野：経営システム工学関連分野（数理・情報・生産管理に見識を持っていることが望ましい）

担当科目：数理計画，オペレーションズ・リサーチ，シミュレーション，その他経営システム工学関連科目

応募資格：着任時期までに博士の学位を有していること 経営システム工学に関する教育・研究に熱意を持っていること 専門分野の業績を有すること

着任時期：平成17年4月1日

提出書類：(1)履歴書（市販用紙使用，写真貼付）及び連絡先，(2)研究業績リスト（著書，学術論文（査読

あり・なし），国際会議論文等に分類のこと），(3)主要論文の別刷（コピーでも可，5編以内），(4)今までの研究の概要（A4用紙1枚程度），(5)今後の研究計画（A4用紙1枚程度），(6)教育に対する抱負（A4用紙1枚程度），(7)本人に関する所見を伺える方2名の氏名及び連絡先

応募締切：平成16年6月15日（火）（必着）

書類の送付先/問合せ先：

〒229-8558 神奈川県相模原市淵野辺5-10-1

青山学院大学理工学部経営システム工学科採用委員会宛

（封筒に「経営システム工学科教員応募書類在中」と朱書し，簡易書留で郵送すること）

Fax.042(759)6556

E-mail: employ@ise.aoyama.ac.jp

● 平成16年度会費納入のお願い(事務局)

平成16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，15年度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。

〔預金口座振替ご希望の方へ〕

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。

● IFORS 2005のご案内

・The 17th Triennial Conference of the International Federation of Operational Research Societies
3年毎に開かれるIFORSの第17回大会が，以下の日程で開催されます。

日程：2005年7月11日～15日

場所：ハワイ，ホノルル

アブストラクト提出期限：2004年12月15日

*大会の案内状（Call for Papers）が学会事務局にあります。ご希望の方は，ご請求下さい。

（社）日本オペレーションズ・リサーチ学会事務局

Tel.03(3815)3351 E-mail: jorsj@orsj.or.jp

*詳しくは，<http://www.informs.org/Conf/IFORS2005/>をご覧ください。