

- Political Economy*, Vol.81, pp.637-654, 1973.
- [2] R. C. Merton: "Theory of Rational Option Pricing," *Bell Journal of Economics and Management Science*, Vol. 4, pp. 141-183, 1983.
- [3] C. W. Smith: "Option Pricing: A Review," *Journal of Financial Economics*, Vol. 3, pp. 3-51, 1976.
- [4] 砂原義文編: "確率システム理論II," 朝倉書店, 東京, 1982.

- [5] L. Arnold: "Stochastic Differential Equations: Theory and Applications," John, Wiley and Sons, New York, 1974.
- [6] 澤木勝茂, 田畑吉雄: "ファイナンスにおける最適停止問題," オペレーションズ・リサーチ, Vol. 17, No. 1, pp. 24-29, 1989.
- [7] たとえば, R. Y. Rubinstein: "Simulation and the Monte Carlo Method," John Wiley and Sons, New York, 1981.



研究部会報告

●最適化とその応用●

●第5回

日時: 平成2年11月27日(火) 14:00~17:00

場所: 神戸商科大学 出席者: 19名

テーマと講師: (1)「ファジイ推論を用いたフレキシブル生産スケジューリング~多様な目的への対応~」鳩野逸生 (大阪大学工学部精密工学教室)

多様なスケジューリング目的に対応可能なフレキシブル生産スケジューリングのための知識ベースをファジイ推論を用いて構成する手法について考察した。

(2)「シミュレーションによる定量評価を含んだ物流制御エキスパートシステムとその実プロセスへの応用」高橋哲也 (神戸製鋼所電子技術研究所)

エキスパート・システムによる定性的判断とシミュレータによる定量評価を組み合わせることにより, 生産現場の物流を最適化するシステムについて議論し, それを製鉄所のビレット精整工程に応用した例が紹介された。

●確立モデルにおける最適化●

●第3回

日時: 12月8日(土) 14:00~17:00

場所: 東京工業大学 本館194号室 参加者: 23名

テーマと講師: (1)「既存企業との価格競争を考慮した参入企業の施設配置問題について」劉威 (東京工業大学)

発表された内容は, 1つの既存企業があるときに1参入企業が総利益を最大にするように施設を配置する問題を扱っている。施設配置問題における目的関数ベクトル (α_{ij}) —施設を候補地 i に置いたときの市場 j から得られる利益—を, 市場 j での既存企業との価格競争による均衡価格から算出するというゲーム論的アプローチをとっている。

(2)「Game Theory における Implementation Problem について」渡辺隆裕 (東京工業大学)

本発表では, 社会的選択関数とその戦略的操作不可能性に焦点を絞ってのチュートリアルが行なわれた。内容としては, Gibbard-Satterthwaite の操作不可能性定理に始まり, Condorcet winner に関連した Moulin の定理等の紹介がなされた。

●経営管理システム●

●第33回

日時: 平成2年12月8日(土) 14:00~17:00

出席者: 8名 場所: 中央区八丁堀 東京都勤労福祉会館

テーマと講師: 「日本のこれからの経営管理システム: イノベーション」上田亀之助 (上田イノベーション研究所・杉野女子大学)

わずか40年で世界の経済大国に成長した日本の経営管理システムは変転きわまらない世界のボーダレス化・グローバル化・多極化・情報化のなかでそれに積極的に順応してゆく必要があります。それには常にイノベーション (創新・新機軸) を推進してゆかなければなりません。