

研究部会報告



る際の注意点などが話された。異常値や対数変換、効用値の総合比較、DMUの定義などが論じられた。

●待ち行列●

・第118回

日時：4月20日(土) 14:00~16:30

出席者：28名

場所：東京工業大学 本館1-94号室

テーマと講師：(1)「UC Berkeley 滞在記：新しい自己
相関のある到着過程モデルの研究」

豊泉 洋 (NTT)

到着間隔が一定の区間とランダムな区間がある確率に従って出現する到着過程モデル($G(m, \alpha)$ と命名)の提案と、自己相関のある到着過程の $G(m, \alpha)$ を用いた近似法、および、 $G(m, \alpha)/M/1$ 待ち行列モデルの解析結果について、交換研究員として1年間滞在したUC Berkeleyの様子を交えながら報告した。

(2)「Leaky Bucket with Gate Algorithm for Connection-Setup Congestion Control in Multimedia Networks」
木村卓巳 (NTT)

複数のコネクションを同時に利用するようなサービスからのコネクション設定要求を一つのグループと考え、そのグループ単位での受け付け率を向上させる輻輳制御法として、待ち客数に依存してゲートが開閉する方法を提案し、シミュレーションによる評価および簡易モデルでの解析結果を示した。

●ファイナンスのOR●

・第18回

日時：4月27日(土) 14:00~17:00

出席者：21名

場所：東京工業大学百年記念館 2F第5会議室

テーマと講師：(1)「信用金庫・組合の信用リスクモデル：その倒産確率の推定リスク管理」

森平爽一郎, 小松幹生, 湯山智教 (慶応義塾大学)

信用リスク管理に関する分かりやすい解説を行い、融資評価のためのキャッシュフロー評価モデルを提示した。線形確率モデル, ロジットモデル, プロビットモデルを用いて、信用金庫・組合の倒産確率を推定し、その結果を示した。

(2)「CAPM with Human Capital, Evidence from Japan」Ravi Jagannathan (University of Min-

●イノベーション●

・第1回

日時：3月2日(土) 14:00~17:00

出席者：10名

場所：中央区新富 東京都勤労福祉会館

テーマ：「イノベーション」

主査の上田が参考資料を作成し、それをたたき台にして、出席者全員で話し合いました。大昔から人類は無数のイノベーションを積み上げて、それで文化・文明を発展・維持することができました。好景気に溺れたり、平和ぼけして、イノベーションを怠りますと、平成のバブル崩壊のごとく、深刻な危機にさらされます。ご用心!

・第2回

日時：5月11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：「イノベーション」

主査の上田が参考資料を作成し、それをたたき台にして出席者全員で話し合いました。イノベーションとは、何か新しい、今までになかった何かを考え出し、実行することですから、いつも誠に取りとめのないモノゴトとつき合いながら、超複雑とか、よく分からないとか、すこぶる曖昧な状況の中で、人間の潜在能力を活用しながら、多くの仮説とも取り組まなければなりません。

●評価のOR●

・第17回

日時：4月20日(土) 13:30~16:30

出席者：61名

場所：青山学院大学総研ビル 7階第10会議室

刀根薫教授(埼玉大学)によるDEA(Data Envelopment Analysis)についてのチュートリアル講演が行われ、これまでで最も多い参加者を得た。講演では前半でDEAの基本的な考え方が説明され、後半でDEAの長所、限界と対処法およびマネジメントに用い

nesota) 久保田敬一 (武蔵大学)
竹原 均 (筑波大学)
人的資本を含むCAPMモデルとして、TOPIX、労働変数、サイズや簿価時価比率に対するリターンズプ

レッドによる4要因モデル(マルチベータCAPM)を示した。そして、Fama-MacBeth回帰やGMMテストにより、実証分析を行い説明力が改善されたことを示した。

会 合 記 録

5月8日(水)	機関誌編集委員会	8名
5月8日(水)	企業サロン企画委員会	8名
5月9日(木)	研究普及委員会	18名
5月10日(金)	庶務幹事会	8名
5月13日(月)	IAOR委員会	3名
5月15日(水)	研究普及委員会	10名
5月16日(木)	論文誌編集委員会	12名
5月22日(水)	理事会	13名

第1回理事会議題 (8-5-22)

平成8年度事業計画及40周年記念事業について
平成7年度評議員会議事録の件
平成7年度第7回理事会議事録の件
平成8年度通常総会議事録の件
入退会承認の件
各支部総会報告の件
平成8年度委員会委員・幹事委嘱の件
受託研究の件
研究普及委員会所掌事項にかかる内規の件
平成8年度第1回セミナー開催及予算案の件

平成8年度役員・支部長名簿

理事 会 長	刀根 薫 (埼玉大学大学院)	〃	〃	生駒 憲治 (NTT データ通信)
〃 副 会 長	平尾 信正 (東京ガス)	〃	〃	黒田 充 (青山学院大学)
〃	伏見 正則 (東京大学大学院)	〃	〃	松山 久義 (九州大学)
〃	山田 郁夫 (三菱総合研究所)	監事		山本 保 (東北コンピュータ サービス)
〃 庶 務	山田 善靖 (東京理科大学)	〃		矢島 敬二 (東京理科大学)
〃	香田 正人 (I.B.M.)			
〃 会 計	山口 俊和 (東京理科大学)	支 部 長		
〃 研究普及	鈴木 久敏 (筑波大学大学院)	北海道支部長	若林 信夫 (小樽商科大学)	
〃	米田 清 (東芝)	東北支部長	松田 泰 (東北電力)	
〃 編 集	逆瀬川浩孝 (早稲田大学)	中部支部長	小谷 重徳 (トヨタ自動車)	
〃	川島幸之助 (NTT)	関西支部長	徳山 博子 (静岡大学)	
〃 国 際	高橋 誠 (電力中央研究所)	中・四国支部長	貝川 健一 (中国電力)	
〃 無 任 所	木村 俊一 (北海道大学)	九州支部長	松山 久義 (九州大学)	