

No. 395
2004年
6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

日時：平成16年9月7日(火) 13:00~17:50
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)
事前振込み参加費：正・賛助会員3,000円, 学生会員1,000円, 非会員4,000円
当日申込み参加費：正・賛助会員4,000円, 学生会員1,000円, 非会員5,000円
(学生の方は、学生証提示で1,000円)

*なお、会員特典として、平成16年から個人正会員(年会費納入済み)がシンポジウムに参加する場合は、春、秋開催のうち年1回に限り、シンポジウム参加費が無料となります。この特典を利用する場合は事前申込が必要です。研究発表会にもご参加の場合は、8月号綴込みの振込用紙の「特典利用」に○をつけて研究発表会参加費をお振込みください。シンポジウムのみご参加の場合は、下記OR学会事務局宛にFAXで記入済み振込用紙を送付、またはメールにて特典利用の旨をご連絡下さい。

講師と講演題目：(順序は未定)

- ・坂本 仁(医療法人社団 坂本医院)
「高齢社会を支える地域ネットワーク」
- ・大内 東, 仙田 崇(北海道大学大学院情報科学研究科)
「介護保険制度と要介護認定アルゴリズム」
- ・魏 大名(会津大学教授)
「コンピュータソフトと福祉・医療(仮題)」
- ・尾股定夫(日大工学部医用工学研究センター, 日本大学工学部教授)
「福祉と医療機器(仮題)」

問合せ先：中山 明(福島大学行政社会学部)
E-mail: nakayama@ads.fukushima-u.ac.jp
OR学会事務局：FAX.03(3815)3352
E-mail: kenkyu@orsj.or.jp

● 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」

日時：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のある方
- ・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・フロー流列」

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) 12:45~14:45

「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）を進呈いたします。

申込み先：

(社)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) 13:30~17:50

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)

プログラム: 司会 中野一夫 (㈱日本オペレーションズ・リサーチ学会副会長)

1. 13:30~13:40 開会の挨拶

久米 均 (日本学術会議第5部部长, 中央大学理工学部教授)

2. 13:40~14:35 特別講演(1)「進展する事業リスク経営—サーベインズ=オクスレイ法からERMへ—」

刈屋武昭 (明治大学ビジネススクール教授)

3. 14:35~15:30 特別講演(2)「総合商社のリスクマネージメント—三井物産の投資リスク管理の変遷を中心として—」

田宮英和 (三井物産㈱会計・リスク統括部統合リスク管理室室長)

4. 15:50~16:45 特別講演(3)「東京ガスの地震リスクに関する取組み」

中山 涉 (東京ガス㈱防災・供給部防災・供給G副課長)

5. 16:45~17:40 特別講演(4)「旭硝子における定量的経営手法への取組み」

山田方敏 (旭硝子㈱経営管理室主幹)

6. 17:40~17:50 閉会の挨拶

今野 浩 (㈱日本オペレーションズ・リサーチ学会会長)

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, ㈱日本経営工学会, ㈱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, ㈱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。

定 員: 200 名

申込み方法: 本号綴込みの参加申込書に必要事項を記入の上, FAX, E-mail または郵送でお送り下さい。参加申込み受付後 (6 月 30 日(水)受付分迄), 参加票を FAX, E-mail または郵送にてお送りいたしません。当日は参加票をご持参下さい。

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
(㈱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ております。

● 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)

● 研究部会・グループ開催案内

{待ち行列}

・ワークショップのご案内

日 程: 6 月 17 日(木), 18 日(金)

場 所: サンシップとやま (富山県総合福祉会館)

Tel.076(432)6141

(JR 富山駅から徒歩 15 分, または市電で富山駅から大学行き「県庁前」下車徒歩 2 分)

* 詳しくは <http://www.wel.pref.toyama.jp/annai/index2.html> をご覧ください。

テーマ: 「新しいネットワークモデル化と性能評価」

プログラム (*は講演者):

17 日 13:00~14:40

1. 「バックボーンネットワークにおける IP トラヒックの短時間スケール特性」

* 中村 元 (㈱ KDDI 研究所), 福嶋正機 (㈱ KDDI 研究所), 滝根哲哉 (京都大学), 古屋裕規 (㈱ KDDI 研究所), 野本真一 (㈱ KDDI 研究所), 渡辺 裕 (㈱ KDDI 研究所)

2. 「カルマンフィルタを用いた End-to-End 利用可能帯域計測方式の検討」

* 井出一郎, 斎藤 洋 (NTT)

3. 「トレンド除去変動解析法による IP パケットトラヒックの自己相似性変動解析」

* 馬杉正男 (NTT)

4. 「複数フローに対する拡散型フロー制御方式」
* 会田雅樹 (NTT), 高野知佐, 村中かほり (NTT-AT)
17日 14:55~16:10
5. 「マルチスレッド型非同期処理システムにおけるサービス残余時間の見積もりについて」
* 坂田洋幸 (㈱NTTデータ), 牧本直樹 (筑波大学)
6. 「2状態マルコフ型到着過程の重畳における階乗メントの表現について」
* 河西憲一 (群馬大学)
7. 「Modified Service Mechanism のある待ち行列とその応用」
* 高橋敬隆 (早稲田大学), 四方義昭 (尚美学園大学)
17日 16:25~17:45
8. 「招待講演」 「無線LANに関するトラヒック研究の一展開」
* 川島幸之助, 大坐畠智 (東京農工大学)
9. 「招待講演」 「再呼を考慮した移動カスタマーモデル」
* 町原文明 (東京電機大学)
18日 9:00~10:40
10. 「BMAPを用いてトラフィックのモデル化およびその性能評価」
* 西村彰一, 兼堀知之 (東京理科大学)
11. 「On the Effect of Finite Buffer Truncation in a Two Node Jackson Network」
* 佐久間大, 宮沢政清, 水野信也 (東京理科大学)
12. 「リアルタイム・ハイブリッドFEC/ARQのモデル化と性能解析」
* 田中啓之, 高橋 豊 (京都大学)
13. 「メッセージ分割機能をもつBernoulli無線通信システムにおけるビット誤り率のTCPスループットに及ぼす影響について」
* 池川隆司 (NTT/東京工業大学), 高橋幸雄 (東京工業大学)
18日 10:55~12:05
14. 「都市空間と通話行動を考慮した移動通信シミュレーション」
金子雅志, 加藤憲一, * 山田孝子 (電気通信大学)
15. 「広域グリッドコンピューティングのための制御理論にもとづく動的資源管理方式」
* 大崎博之, 渡部創史, 今瀬 真 (大阪大学)

16. 「センサネットワークにおけるノード密度と接続性に関する一検討」
* 土屋利明, 斎藤 洋 (NTT)
共催: 電子情報通信学会, 情報ネットワーク (IN) 研究会
参加費: 資料代5,000円 (予定)
懇親会: 17日の発表終了後, 懇親会を企画しております。奮ってご参加下さい。
懇親会費: 4,000円 (予定)
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
〔不確実性下のモデル分析とその応用〕
・第13回
日時: 7月10日(土) 14:00~17:00
場所: 九州大学経済学部5階510A演習室
テーマと講師:
(1)「A heuristic approach to discover the most effective measure in one-to-many relationship」
伊藤孝夫 (宇部高専・経営情報学科)
(2)「在庫管理と情報共有の効果について」
大久保幸夫 (鹿児島国際大学・経済学部)
問合せ先: 九州大学大学院経済学研究院 時永祥三
Tel/Fax.092(642)2466
E-mail: tokenaga@en.kyushu-u.ac.jp

● 会合案内

- 〔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
- 〔第240回新宿OR研究会〕
日時: 7月20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: 「アルプス越え鉄道の今昔」
講師: 福地合一氏 (日仏工業技術会副会長)
参加費: 3,000円
問合せ先: 日本OR学会事務局

● 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。

・第34回信頼性・保安全性シンポジウム

主催：(財)日本科学技術連盟

日程：7月8日(木)、9日(金)

場所：日本科学未来館(江東区青海)

問合せ先：(財)日本科学技術連盟応用システム課 R & MS 担当

Tel.03(5378)9850 Fax.03(5378)9844

E-mail: re-group@juse.or.jp

・今求められる社会資本整備の役割とその方法論

日時：平成16年7月14日(水) 13:00~18:00

場所：都市センターホテルコスモスホール(地下鉄永田町徒歩2分)

東京都千代田区平河町2-4-1 Tel.03(3265)8211

主催：名城大学オープンリサーチセンター

後援：(社)土木学会、(社)日本オペレーションズ・リサーチ学会、(社)日本都市計画学会

プログラム：

12:30 開場

13:00 開会

13:00~13:10 挨拶 名城大学オープンリサーチセンター長 若松貴英

第1部 バランスシート不況下における社会資本整備の役割

13:10~13:50 基調講演「神の見えざる手と合成の誤謬の世界」

木下栄蔵(名城大学)

13:50~14:50 招待講演「デフレとバランスシート不況の経済学」

リチャード・クー氏(株)野村総合研究所

14:50~15:10 質疑応答

第2部 参加型社会の決め方

15:30~16:00 「参加型計画の必要性和その現状」
高野伸栄(北海道大学)

16:00~16:20 「決めるために必要な組織」

谷口 守(岡山大学)

16:20~16:40 「集団意思決定における利害構成の分析」

谷本圭志(鳥取大学)

16:40~17:00 「合意を導く決め方の条件」

藤井 聡(東京工業大学)

17:00~17:20 「プロジェクト立案・管理手法」

山中英生(徳島大学)

17:20~17:40 「問題解決型モデル」

中西昌武(名古屋経済大学)

17:40~18:00 質疑応答

おわりに

18:00 閉会

参加費：無料(ただしテキスト代当日徴収、代金未定)

*参加ご希望の方は氏名、所属名、メールアドレスを kinoshit@urban.meijo-u.ac.jp 宛に、題名：7.14 参加希望と明記し送信して下さい(尚、応募者多数の場合、お断りさせていただく場合がございます)。

●公募案内

・東京理科大学工学部第二部経営工学科

募集人数：教授 1名

専門分野：数理工学、質管理工学、またはその関連分野

担当科目：具体的担当科目については、面接時に相談。

勤務時間：午後3:00~午後9:30

応募資格：(1)博士の学位、またはそれと同等以上の研究業績を有する方、(2)大学院での研究指導、教育を担当できる方、(3)原則として年齢50~60歳の方(注：本学の教員の定年は65歳)、(4)経営工学に強い関心・経験があり、学科主任をお引受け頂ける方。

着任時期：平成16年10月1日

提出書類：(1)履歴書(写真添付、E-mailアドレス記入)、(2)研究業績リスト、(3)主要論文別刷または著書計3編、(4)研究、教育に対する抱負、特に社会人を含む多様な学生を対象とした夜間教育について(A4版2ページ以内)

応募締切：平成16年6月18日(金)(必着)

書類送付先及び問合せ先：

〒162-8601 東京都新宿区神楽坂1-3

東京理科大学工学部第二部経営工学科
主任 狩野紀昭

*封筒に「工学部第二部経営工学科教授応募書類在中」と朱書き、書留で郵送のこと)

主任 狩野紀昭 Tel.03(5228)8353

E-mail: kano_n@ms.kagu.tus.ac.jp

教授 高橋武則 Tel.03(5228)8335

E-mail: takenori@ms.kagu.tus.ac.jp

*本学科についての情報は、<http://www.rs.kagu.tus.ac.jp/kougaku2/mana/> をご覧下さい。