

次号予告

特集 金融工学の広がり

- 一般化フィルトレーションと二項資産価格モデル.....足立高德 (東京都立大学大学院経営学研究科),
中島克志 (立命館アジア太平洋大学国際経営学部), 琉 佳勳 (立命館大学理工学部数理科学科)
金融リスク計測のための確率金利モデルの提案—国際的規制の流れとは異なる視点から—
.....室町幸雄 (東京都立大学大学院経営学研究科)
資産リターンの予測可能性と機械学習—危険なデータマイニング—
.....内山朋規 (東京都立大学大学院経営学研究科),
瀧澤秀明・菊川 匡 (野村證券(株)ストラクチャード・プロダクト部)
接合関数を用いた誤方向リスクのモデリング.....安達哲也 (PwCコンサルティング合同会社),
末重拓己 (KPMG Ignition Tokyo), 吉羽要直 (東京都立大学大学院経営学研究科)
マイナス金利モデルについて—金利デリバティブの視点から—
.....竹原浩太 (東京都立大学大学院経営学研究科)
オプション価格格式を用いたコーポレートファイナンス理論モデル
.....芝田隆志 (東京都立大学大学院経営学研究科)

メーリングリストに登録しよう

会員の方は、本学会のメーリングリストに登録すると、学会ならびに各研究部会の主催する研究発表会・セミナー等の催し物に関する最新情報が得られます。登録方法については、<http://www.orsj.or.jp/members/mlhowto.html>をご覧ください。

編集後記

●この編集後記は4月末に書いており、昨日秋季大会も春季に続けて中止という大変残念な連絡がありました。現在、コロナウイルスによる戦後最大級ともいべき社会活動の変化の渦に世界中が巻き込まれています。従来ならば苦難に立ち向かうときには、お互い直接顔を合わせて励ましあいながら苦難を乗り越えてきましたが、こうしたやり方すらできないという前代未聞の対応が求められています。日常活動については、企業はテレワークが推進され、ほとんどの大学では卒業式・入学式の中止のみならず講義もオンラインで(スケジュールも遅れて)開講するところが多あります。現在の情報通信技術の発展のおかげで、こうした働き方や学び方ができるようになりました。20年前ではできなかったでしょう。まずは守るべき

行動規範をしっかりと守りながら、終息・収束に向けたさまざまな取組みが必要とされています。

●ここまで書いてみて、改めて本号の特集を拝読しました。本号では筑波大学に設立された人工知能科学センターに関わる方々による「機械学習の手法と役割期待」が特集です。実は今回の苦難に立ち向かうための情報活用のヒントが多く含まれている、ということに気づかされました。動画のリアルタイムのやり取りや効率的な情報のやり取りは、情報圧縮や汎化能力の高いモデリングが実はその根幹技術であり、UIを実現するソフトウェアほど目立たないものの、そのアルゴリズムとして社会基盤を支える技術の塊です。社会を支えていくORに今後も期待します。

(生田目崇)

オペレーションズ・リサーチ 編集委員会

- 委員長 繁野 麻衣子 (筑波大学)
特集担当編集委員 高野 祐一 (筑波大学)
委員 朝日 弓未 (東海大学), 伊豆永 洋一 (神奈川大学), 井床 利生 (IBM基礎研究所), 井家 敦 (神奈川工科大学), 鶴飼 孝盛 (防衛大学校), 大竹 恒平 (東海大学), 加藤 怜 (公益財団法人鉄道総合技術研究所), 小林 隆史 (立正大学), 佐久間 大 (防衛大学校), 笹谷 俊徳 (東京ガス株式会社), 猿渡 康文 (筑波大学), 生田目 崇 (中央大学), 野々部 宏司 (法政大学), 蓮池 隆 (早稲田大学), 原田 耕平 (株式会社NTTデータ数理システム), 山本 零 (慶應義塾大学), 吉田 琢史 (株式会社東芝)

本誌に掲載された記事についての著作権は、公益社団法人 日本オペレーションズ・リサーチ学会に帰属する。

オペレーションズ・リサーチ

令和2年6月号 第65巻 第6号 通巻714号

代表者 田口 東

発行所 公益社団法人 日本オペレーションズ・リサーチ学会

東京都千代田区岩本町1-13-5 サン・チカビル7F

電話 03-3851-6100 FAX 03-3851-6055 〒101-0032

<http://www.osrj.or.jp/>

編集人 繁野 麻衣子

発売所 株式会社 日科技連出版社

東京都渋谷区千駄ヶ谷5-15-5 〒151-0051

- ・本誌購読のお申込みは、日本オペレーションズ・リサーチ学会へ。
- ・本誌への広告のお申込みは、明報社 (Tel 03-3546-1337) へ。