

Chanaka Edirisinghe 教授 講演会報告



目で見る
海外講師講演会

森田 浩*

The lecture by Professor Chanaka Edirisinghe
Stochastic Data Envelopment Analysis and Application to Portfolio Selection

Key Words : Data envelopment analysis, stochastic model, sector portfolio

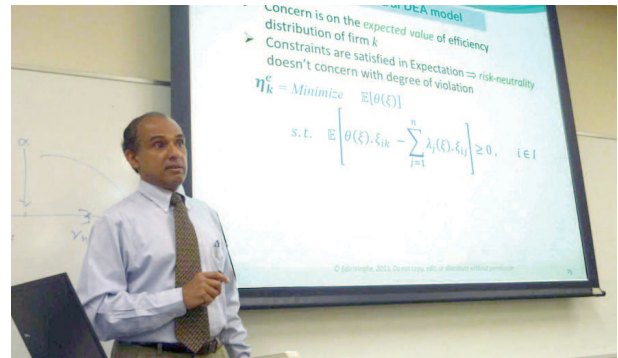
- <講演会名> Chanaka Edirisinghe 教授 講演会
“Stochastic Data Envelopment Analysis and Application to Portfolio Selection”
<開催場所> 大阪大学大学院情報科学研究科情報科学A棟101号室
<開催時期> 平成25年6月1日午後3時より

Chanaka Edirisinghe 教授 (米国テネシー大学経営学部) は、確率計画法、最適化が専門で、特に企業のファンダメンタル分析やポートフォリオ選択などのファイナンス分野への応用研究に顕著な業績を上げられています。このたびの講演会は日本オペレーションズ・リサーチ学会「評価のOR」常設研究部会の第54回研究会と共催で行われ、データ包絡分析法 (data envelopment analysis) の確率的モデルとその応用に関して講演をしていただきました。

包絡分析法は、投入を産出に変換する効率性を分析する方法の一つで、数理計画法を用いて定量的に経営効率や活動効率を評価するのに広く利用されます。本講演では、将来の活動の効率性を予測するときには不確実性を考慮しなければならないということから、確率的計画法を導入した評価法について、その基本的な考え方から丁寧に紹介され、ポートフォリオ選択問題への適用事例も報告されました。確率的な取り扱いはい前から考えられているものの、

実際に適用された事例はまだ多くなく、今後の展開が期待されています。適用するときの問題点や今後の方向性についての質疑があり、大変有意義な情報交換ができました。

Edirisinghe 教授は、関西大学の客員教授として来日されていたという幸運に恵まれ、この時期に開催することができました。また、生産技術振興協会の海外講師講演会奨励事業の支援を受けております。関係各位に厚く御礼申し上げます。



Dr. Chanaka Edirisinghe

Professor and PhD Director of the Management Science program, University of Tennessee, USA
PhD, Management Science, University of British Columbia, Canada

*講演会主催者 大阪大学大学院 情報科学研究科 システム数学講座 教授