

電気通信大学 平成20年度シラバス

授業科目名	オペレーションズリサーチB		
英文授業科目名	Operations Research B		
開講年度	2008年度	開講年次	2年次
開講学期	後学期	開講コース・課程	昼間コース
授業の方法	講義	単位数	2
科目区分	専門科目-学科専門科目-選択必修科目		
開講学科・専攻	システム工学科		
担当教官名	宮崎 浩一		
居室	西5-503		

公開E-Mail	授業関連Webページ

<p>【主題および達成目標】</p> <p>(a)主題</p> <p>オペレーションズ・リサーチは、合理的な意思決定を行なうためにモデルや手法の開発を研究し、人、組織、経済・金融の行動・現象を数量的に把握し分析する学問である。オペレーションズ・リサーチBでは、確率的概念の入ったモデルや手法について学ぶ。</p> <p>この科目は、経営工学分野や数理工学分野への橋渡しとなる基礎科目である。</p> <p>(b)達成目標：</p> <p>(1)新聞の売り子問題を理解して活用できる。</p> <p>(2)需要の推定を行なうことができる。</p> <p>(3)主な意思決定基準を理解して活用できる。</p> <p>(4)意思決定における情報の価値を求めることができる。</p> <p>(5)期待効用基準を理解して活用できる。</p> <p>(6)待ち行列理論 ($M/M/1$) において、平衡方程式をたてて平均系内数、待っている客の平均数、平均滞在時間、待たなければならない確率、待ち時間の分布等が求められる。</p> <p>(7)待ち行列理論 ($M/M/s$) においても、(8)と同様のことができる。また、待ち行列に制限がある場合に関しても把握する。</p> <p>(8)オプション理論を踏まえた投資の意思決定ができる。</p>
--

【前もって履修しておくべき科目】
なし

【前もって履修しておくことが望ましい科目】
オペレーションズ・リサーチA、確率統計工学基礎第一

--

【教科書等】

小和田正、加藤豊 共著、例解OR 実教出版
宮崎浩一 著 証券分析への招待 サイエンティスト社

【授業内容とその進め方】

第一回	確率統計の復習
第二回	新聞の売り子問題
第三回	回帰モデルによる需要予測
第四回	意思決定における情報の価値
第五回	期待効用基準
第六回	(予備)補足や演習など
第七回	中間試験
第八回	待ち行列理論1
第九回	待ち行列理論2
第十回	待ち行列理論3
第十一回	オプション理論1
第十二回	オプション理論2
第十三回	(予備)補足や演習など
第十四回	期末試験

【成績評価方法及び評価基準(最低達成基準を含む)】

(a)評価方法：
中間試験(50点)、期末試験(50点)として、これらの合計点で決める。
(b)評価基準：
達成目標に記した事項をある程度理解したといえる水準、
上記試験の合計点が60点以上であることを基準とする。

【オフィスアワー：授業相談】

金曜日：16:00-18:00

【学生へのメッセージ】

経済的に合理性のある最適解を得るために現実の問題をいかにして 数理的な枠組みにモデル化するか、またそのモデルの解の求め方を一緒に学びましょう。

電気通信大学 平成20年度シラバス

【その他】