

# 長崎大学経済学会・2013年度第3回ファカルティセミナー 合同研究会

標記研究会を以下の要領で開催いたします。教職員、大学院生、学生の参加をお待ちしています。

日 時： 平成 25年 7月 8日（月） 14：30～16：00

場 所： 東南アジア研究所 1階 ファカルティセミナー室

報告者： 折登 由希子 氏（広島大学大学院社会科学研究所）

報告タイトル： 計算複雑性のある問題へのアプローチ  
ー進化計算によるポートフォリオの最適化ー

## 要 旨：

経済学を含む社会科学分野における最適化問題に対して、解析的な方法による理論上の最適解、あるいは数値的な方法による精度の保証された最適解の導出がトライされてきた。しかしながら、より現実的で複雑な問題に対しては、これらの方法により最適解を得ることができない。

一方、近年では、応用経済学などの分野においても、計算複雑性のある諸問題の最適化方法として、従来は工学分野で発展してきた進化計算を適用した事例が報告されるようになってきている。

本報告では、計算複雑性のある一問題として、ポートフォリオの最適化問題を取り上げ、この問題に対する新たな最適化手法として、進化計算によるアプローチの詳細を紹介する。進化計算は、準最適解の探索的な手法の総称であり、非凸目的関数に対する微分値を使わない最適化手法である。東証1部市場におけるポートフォリオの構築を実験結果として報告する。

ファカルティセミナーでの報告を希望される方は、研究委員会ファカルティセミナー担当者（大倉）までご連絡下さい（メール：[okura@nagasaki-u.ac.jp](mailto:okura@nagasaki-u.ac.jp) 内線：328）。また外部者による報告も受け付けています。