意思決定科学
DEA（包絡分析法）

堀田敬介

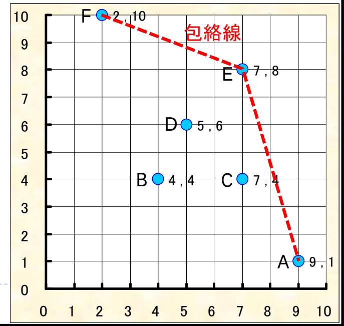
2016年1月22日（金）

考えよう

- あなたは6つの店舗をもつ社長だ．今年1年間の業績が最もよい店舗を表彰して他店舗の模範とし，次年度も切磋琢磨させたい．さて，あなたはどの店舗を表彰するのか？

	A店	B店	C店	D店	E店	F店
営業費	56	100	86	100	57	250
人員数	500	100	150	83	50	50
売上	500	400	600	500	400	500

	A店	B店	C店	D店	E店	F店
売上/費	9	4	7	5	7	2
売上/人	1	4	4	6	8	10

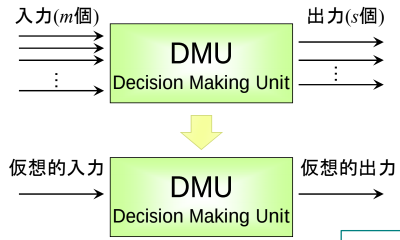


Contents

DEAとは？

- DEA (Data Envelopment Analysis)

envelop＝包む
envelopment＝包むこと
c.f.) envelope＝封筒



最も変換効率の良いDMUを基準として，他のDMUの非効率性を算出し，比較する．ただし，変換効率はDMU毎に最も有利になるように計算．

比率尺度を効率性と見なして相対比較

$$\text{DMUの変換効率} = \frac{\text{仮想的出力}}{\text{仮想的入力}}$$

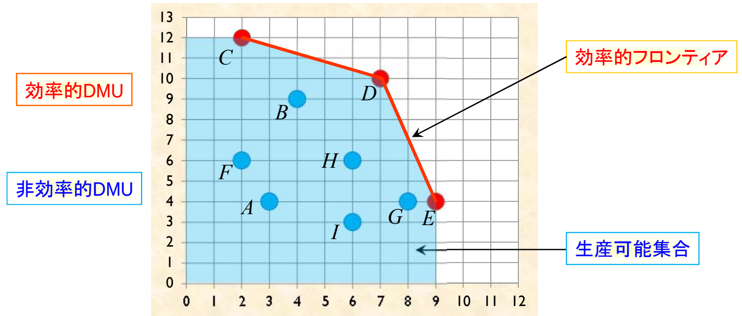
DEAとは？

- 2入力・1出力
  - 例）店舗売上

	店舗(DMU)	A	B	C	D	E	F	G	H	I
入力1	従業員数	4	9	6	3	4	6	3	6	4
入力2	売場面積	3	4	1	2.1	9	2	6	6	8
出力	売上高	12	36	12	21	36	12	24	36	24

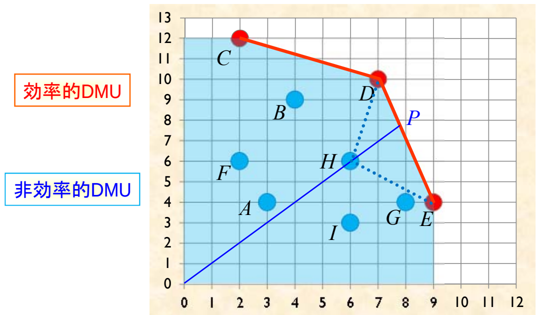
DEAとは？

	店舗(DMU)	A	B	C	D	E	F	G	H	I
出力/入力1	売上高/従業員数	3	4	2	7	9	2	8	6	6
出力/入力2	売上高/売場面積	4	9	12	10	4	6	4	6	3



DEAとは？

	店舗(DMU)	A	B	C	D	E	F	G	H	I
出力/入力1	売上高/従業員数	3	4	2	7	9	2	8	6	6
出力/入力2	売上高/売場面積	4	9	12	10	4	6	4	6	3

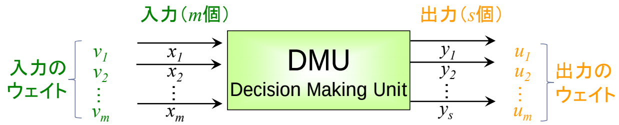


効率的DMU *C,D,E* の効率値は ***1.0***

非効率的DMU *H* の非効率値は *OH/OP* であり *H* の有位(参照)集合は *D* と *E*

DEA：CCRモデル

- 多入力・多出力



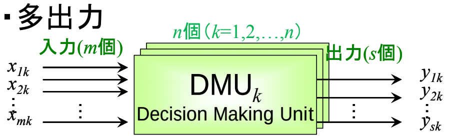
$$\begin{cases} \text{仮想的入力} := v_1 \times x_1 + v_2 \times x_2 + \ldots + v_m \times x_m \\ \text{仮想的出力} := u_1 \times y_1 + u_2 \times y_2 + \ldots + u_s \times y_s \end{cases}$$

$$\text{効率性（生産性）} := \frac{u_1 \times y_1 + u_2 \times y_2 + \ldots + u_s \times y_s}{v_1 \times x_1 + v_2 \times x_2 + \ldots + v_m \times x_m}$$

入力・出力のウェイトは可変 ⇔ 固定ウェイト

DEA：CCRモデル

- 多入力･多出力



入力データ行列　　出力データ行列

$$X=\begin{array}{c}\text{DMU数}(n\text{個})\\ \begin{pmatrix} x_{11} & \cdots & x_{1n}\\ \vdots & \ddots & \vdots \\ x_{m1} & \cdots & x_{mn}\end{pmatrix}\end{array}\left.\vphantom{\begin{pmatrix}a\\a\\a\end{pmatrix}}\right\}\text{入力数}(m)\qquad Y=\begin{array}{c}\text{DMU数}(n\text{個})\\ \begin{pmatrix} y_{11} & \cdots & y_{1n}\\ \vdots & \ddots & \vdots \\ y_{s1} & \cdots & y_{sn}\end{pmatrix}\end{array}\left.\vphantom{\begin{pmatrix}a\\a\\a\end{pmatrix}}\right\}\text{出力数}(s)$$

入力データ用ウェイトベクトル　　出力データ用ウェイトベクトル

$$\boldsymbol{v}=(v_1 \ \cdots \ v_m)^T \qquad \boldsymbol{u}=(u_1 \ \cdots \ u_s)^T$$

DMU$_k$の仮想入力　　DMU$_k$の仮想出力

- $q_k := \sum_{i=1}^{m} v_i x_{ik} \quad (k=1,\cdots,n) \qquad r_k := \sum_{j=1}^{s} u_j y_{jk} \quad (k=1,\cdots,n)$

DEA：CCRモデル

- 多入力･多出力
  - 測定対象DMU$_o$(o=1,…,n)のウェイトを計算する

分数計画問題

$$\langle FP_o\rangle \quad \begin{array}{|l} \max.\theta_o := \dfrac{u_1y_{1o}+\cdots+u_sy_{so}}{v_1x_{1o}+\cdots+v_mx_{mo}} \\ s.t. \quad \dfrac{u_1y_{1k}+\cdots+u_sy_{sk}}{v_1x_{1k}+\cdots+v_mx_{mk}} \le 1 \ (k=1,\cdots,n) \\ \qquad v_1,\cdots,v_m \ge 0 \\ \qquad u_1,\cdots,u_s \ge 0 \end{array}$$

対象のDMUの効率性を最大化

全てのDMUの効率性は1以下

入出力用可変ウェイトの変数は非負

同値 ([1])

線形計画問題

$$\langle LP_o\rangle \quad \begin{array}{|l} \max.\theta_o := u_1y_{1o}+\cdots+u_sy_{so} \\ s.t. \quad v_1x_{1o}+\cdots+v_mx_{mo} = 1 \\ \qquad u_1y_{1k}+\cdots+u_sy_{sk} \le v_1x_{1k}+\cdots+v_mx_{mk} \\ \qquad\qquad (k=1,\cdots,n) \\ \qquad v_1,\cdots,v_m \ge 0 \\ \qquad u_1,\cdots,u_s \ge 0 \end{array}$$

<FP_o>の目的関数について分母を1にし，分子を最大化

<FP_o>の制約の分母を払う

注）全部でn個のLPを解く！

DEA：CCRモデル

- 多入力･多出力
  - 効率性について

$$\langle LP_o\rangle \quad \begin{array}{|l} \max.\theta_o := u_1y_{1o}+\cdots+u_sy_{so} \\ s.t. \quad v_1x_{1o}+\cdots+v_mx_{mo} = 1 \\ \qquad u_1y_{1k}+\cdots+u_sy_{sk} \le v_1x_{1k}+\cdots+v_mx_{mk} \ (k=1,\cdots,n) \\ \qquad v_1,\cdots,v_m \ge 0 \\ \qquad u_1,\cdots,u_s \ge 0 \end{array}$$

Def：　DMU$_o$ がD効率的　⇔　$\theta_o^* = 1$
　　　DMU$_o$ がD非効率的　⇔　$\theta_o^* < 1$

注）D効率的だからといって効率的とは言えない

Lem：DMU$_o$がD非効率的，即ち $\theta_o^* < 1$ なら
$\exists k \in \{1,\cdots,n\},\ u_1^*y_{1k}+\cdots+u_s^*y_{sk} = v_1^*x_{1k}+\cdots+v_m^*x_{mk}$

E$_o$に属するDMUはD効率的

この等号を満たすkの集合をDMU$_o$の優位集合（or 参照集合)という

Def：　DMU$_o$ の優位集合（or 参照集合）
$E_o := \left\{k \in \{1,\cdots,n\} \,\middle|\, u_1^*y_{1k}+\cdots+u_s^*y_{sk} = v_1^*x_{1k}+\cdots+v_m^*x_{mk}\right\}$

効率的フロンティアの一部を形成

DEA：CCRモデル

- 多入力･多出力
  - <LP_o>の双対問題と最適解について

CCRモデル

$$\langle LP_o\rangle \quad \begin{array}{|l} \max.\theta_o := u_1y_{1o}+\cdots+u_sy_{so} \\ s.t. \quad v_1x_{1o}+\cdots+v_mx_{mo} = 1 \\ \qquad u_1y_{1k}+\cdots+u_sy_{sk} \le v_1x_{1k}+\cdots+v_mx_{mk} \ (k=1,\cdots,n) \\ \qquad v_1,\cdots,v_m \ge 0 \\ \qquad u_1,\cdots,u_s \ge 0 \end{array}$$

双対問題

DMU$_o$の入力i　　入力i の重み和

$$\langle D_o\rangle \quad \begin{array}{|l} \min.\theta \\ s.t. \quad \theta x_{io} - (x_{i1}\lambda_1+\cdots+x_{in}\lambda_n) \ge 0 \ (i=1,\cdots,m) \\ \qquad (y_{j1}\lambda_1+\cdots+y_{jn}\lambda_n) - y_{io} \ge 0 \ (j=1,\cdots,s) \\ \qquad \lambda_1, \ \cdots, \ \lambda_n \ge 0 \end{array}$$

出力j の重み和　　DMU$_o$の出力j

- $\begin{cases} d_i^x := \theta x_{io} - (x_{i1}\lambda_1+\cdots+x_{in}\lambda_n) \ (i=1,\cdots,m) \\ d_j^y := (y_{j1}\lambda_1+\cdots+y_{jn}\lambda_n) - y_{io} \ (j=1,\cdots,s) \end{cases}$

入力の余剰
出力の不足

DEA：CCRモデル

- 多入力・多出力
  - 入力の余剰と出力の不足を求める

入力の余剰の和　出力の不足の和

$$
\begin{aligned}
&\max.\ (d_1^x+\cdots+d_m^x)+(d_1^y+\cdots+d_s^y)\\
&s.t.\quad d_i^x=\theta^* x_{io}-(x_{i1}\lambda_1+\cdots+x_{in}\lambda_n)\quad (i=1,\cdots,m)\\
&\qquad\ d_j^y=(y_{j1}\lambda_1+\cdots+y_{jn}\lambda_n)-y_{io}\quad (j=1,\cdots,s)\\
&\qquad\qquad \lambda_1,\cdots,\lambda_n\ge 0\\
&\qquad\qquad d_1^x,\cdots,d_m^x\ge 0\\
&\qquad\qquad d_1^y,\cdots,d_s^y\ge 0
\end{aligned}
$$

<LP_o>の最適値

DEAの実行手順

<D_O>を解いて最適解 $(\theta^*,\lambda_1^*,\cdots,\lambda_n^*)$ を得た後,
このLPを解いて最適解 $(d_1^{x*},\cdots,d_m^{x*},d_1^{y*},\cdots,d_s^{y*})$ を得る.

Def：DEA効率性の定義
$\theta^*=1,(d_1^{x*},\cdots,d_m^{x*},d_1^{y*},\cdots,d_s^{y*})=\mathbf{0}$ となるDMUはDEA効率的
それ以外のDMUはDEA非効率的

DEA：CCRモデル

- 例題
  - 「意思決定科学」受講学生の効率性

学生(DMU)	A	B	C	D	E	F	
勉強時間 x_1	40	20	15	30	20	16	v_1
授業集中度 x_2	0.8	0.2	1	0.5	0.9	1	v_2
出席率 x_3	1	0.9	0.8	0.9	1	1	v_3
中間試験 y_1	40	60	30	20	70	50	u_1
期末試験 y_2	30	90	55	70	24	60	u_2

効率性(生産性)：$=\dfrac{u_1\times y_1+u_2\times y_2}{v_1\times x_1+v_2\times x_2+v_3\times x_3}$

DEA：CCRモデル

学生(DMU)	A	B	C	D	E	F	
勉強時間 x_1	40	20	15	30	20	16	v_1
授業集中度 x_2	0.8	0.2	1	0.5	0.9	1	v_2
出席率 x_3	1	0.9	0.8	0.9	1	1	v_3
中間試験 y_1	40	60	30	20	70	50	u_1
期末試験 y_2	30	90	55	70	24	60	u_2

- 学生A(DMU$_A$)の効率性を求める

分数計画問題 <FP_A>

$$
\begin{aligned}
&\max.\ \theta:=\frac{40u_1+30u_2}{40v_1+0.8v_2+v_3}\\
&s.t.\ \frac{40u_1+30u_2}{40v_1+0.8v_2+v_3}\le 1\\
&\quad \frac{60u_1+90u_2}{20v_1+0.2v_2+0.9v_3}\le 1\\
&\quad \frac{30u_1+55u_2}{15v_1+v_2+0.8v_3}\le 1\\
&\quad \frac{20u_1+70u_2}{30v_1+0.5v_2+0.9v_3}\le 1\\
&\quad \frac{70u_1+24u_2}{20v_1+0.9v_2+v_3}\le 1\\
&\quad \frac{50u_1+60u_2}{16v_1+v_2+v_3}\le 1\\
&\quad v_1,v_2,v_3\ge 0,u_1,u_2\ge 0
\end{aligned}
$$

線形計画問題 <LP_A>

(P)主問題

$$
\begin{aligned}
&\max.\ 40u_1+30u_2\\
&s.t.\quad 40v_1+0.8v_2+v_3=1\\
&\quad 40u_1+30u_2\le 40v_1+0.8v_2+v_3\\
&\quad 60u_1+90u_2\le 20v_1+0.2v_2+0.9v_3\\
&\quad 30u_1+55u_2\le 15v_1+v_2+0.8v_3\\
&\quad 20u_1+70u_2\le 30v_1+0.5v_2+0.9v_3\\
&\quad 70u_1+24u_2\le 20v_1+0.9v_2+v_3\\
&\quad 50u_1+60u_2\le 16v_1+v_2+v_3\\
&\quad v_1,v_2,v_3\ge 0,u_1,u_2\ge 0
\end{aligned}
$$

(D)双対問題

$$
\begin{aligned}
&\min.\ \theta\\
&s.t.\ 40\theta-(40\lambda_1+20\lambda_2+15\lambda_3+30\lambda_4+20\lambda_5+16\lambda_6)\ge 0\\
&\quad 0.8\theta-(0.8\lambda_1+0.2\lambda_2+\lambda_3+0.5\lambda_4+0.9\lambda_5+\lambda_6)\ge 0\\
&\quad \theta-(\lambda_1+0.9\lambda_2+0.8\lambda_3+0.9\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)\ge 0\\
&\quad (40\lambda_1+60\lambda_2+30\lambda_3+20\lambda_4+70\lambda_5+50\lambda_6)-40\ge 0\\
&\quad (30\lambda_1+90\lambda_2+55\lambda_3+70\lambda_4+24\lambda_5+60\lambda_6)-30\ge 0\\
&\quad \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6\ge 0
\end{aligned}
$$

DEA：CCRモデル

学生(DMU)	A	B	C	D	E	F	
勉強時間 x_1	40	20	15	30	20	16	v_1
授業集中度 x_2	0.8	0.2	1	0.5	0.9	1	v_2
出席率 x_3	1	0.9	0.8	0.9	1	1	v_3
中間試験 y_1	40	60	30	20	70	50	u_1
期末試験 y_2	30	90	55	70	24	60	u_2

- 学生A(DMU$_A$)の効率性を求める

線形計画問題 <LP_A>

$$
\begin{aligned}
&\min.\ \theta\\
&s.t.\ 40\theta-(40\lambda_1+20\lambda_2+15\lambda_3+30\lambda_4+20\lambda_5+16\lambda_6)\ge 0\\
&\quad 0.8\theta-(0.8\lambda_1+0.2\lambda_2+\lambda_3+0.5\lambda_4+0.9\lambda_5+\lambda_6)\ge 0\\
&\quad \theta-(\lambda_1+0.9\lambda_2+0.8\lambda_3+0.9\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)\ge 0\\
&\quad (40\lambda_1+60\lambda_2+30\lambda_3+20\lambda_4+70\lambda_5+50\lambda_6)-40\ge 0\\
&\quad (30\lambda_1+90\lambda_2+55\lambda_3+70\lambda_4+24\lambda_5+60\lambda_6)-30\ge 0\\
&\quad \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6\ge 0
\end{aligned}
$$

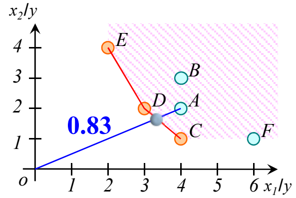
<LP_A>の最適値
$\theta^*=1$なら
次のLPも解く

$$
\begin{aligned}
&\max.\ (d_1^x+d_2^x+d_3^x)+(d_1^y+d_2^y)\\
&s.t.\ d_1^x=40\cdot\theta^*-(40\lambda_1+20\lambda_2+15\lambda_3+30\lambda_4+20\lambda_5+16\lambda_6)\\
&\quad d_2^x=0.8\cdot\theta^*-(0.8\lambda_1+0.2\lambda_2+\lambda_3+0.5\lambda_4+0.9\lambda_5+\lambda_6)\\
&\quad d_3^x=\theta^*-(\lambda_1+0.9\lambda_2+0.8\lambda_3+0.9\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)\\
&\quad d_1^y=(40\lambda_1+60\lambda_2+30\lambda_3+20\lambda_4+70\lambda_5+50\lambda_6)-40\\
&\quad d_2^y=(30\lambda_1+90\lambda_2+55\lambda_3+70\lambda_4+24\lambda_5+60\lambda_6)-30\\
&\quad d_1^x,d_2^x,d_3^x,d_1^y,d_2^y,\lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6\ge 0
\end{aligned}
$$

DEA：CCRモデル

- 例題2（[3] p.15）

DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	4	4	4	3	2	6
入力2 x_2	2	3	1	2	4	1
出力 y	1	1	1	1	1	1



DMU A についての問題

$$\min.\theta$$
$$\begin{aligned} s.t.\ & 4\theta-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \geq 0 \\ & 2\theta-(2\lambda_1+3\lambda_2+\lambda_3+2\lambda_4+4\lambda_5+\lambda_6) \geq 0 \\ & (\lambda_1+\lambda_2+\lambda_3+\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)-1 \geq 0 \\ & \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6 \geq 0 \end{aligned}$$

最適解：$\theta^*=0.83$, $(\lambda_1^*,\lambda_2^*,\lambda_3^*,\lambda_4^*,\lambda_5^*,\lambda_6^*)=(0,0,0.33,0.67,0,0)$

$$\begin{cases} \text{入力）} 0.83\times A = 0.33\times C + 0.67\times D \\ \text{出力）} A = 0.33\times C + 0.67\times D \end{cases}$$

$$\begin{cases} (input) 0.83\times\binom{4}{2} = 0.33\times\binom{4}{1} + 0.67\times\binom{3}{2} \\ output)\ (1) = 0.33\times(1) + 0.67\times(1) \end{cases}$$

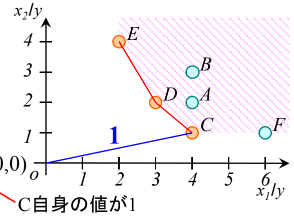
DMU A はDEA非効率的で，優位集合はCとD

DEA：CCRモデル

DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	4	4	4	3	2	6
入力2 x_2	2	3	1	2	4	1
出力 y	1	1	1	1	1	1

- 例題2 DMU C についての問題

$$\min.\theta$$
$$\begin{aligned} s.t.\ & 4\theta-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \geq 0 \\ & \theta-(2\lambda_1+3\lambda_2+\lambda_3+2\lambda_4+4\lambda_5+\lambda_6) \geq 0 \\ & (\lambda_1+\lambda_2+\lambda_3+\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)-1 \geq 0 \\ & \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6 \geq 0 \end{aligned}$$



最適解：$\theta^*=1$, $(\lambda_1^*,\lambda_2^*,\lambda_3^*,\lambda_4^*,\lambda_5^*,\lambda_6^*)=(0,0,1,0,0,0)$

C自身の値が1

DMU C の入力余剰・出力不足チェック問題

$$\max.(d_1^x+d_2^x)+(d_1^y)$$
$$\begin{aligned} s.t.\ & d_1^x = 1\cdot 4-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \\ & d_2^x = 1\cdot 1-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \\ & d_1^y = (\lambda_1+\lambda_2+\lambda_3+\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)-1 \\ & \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6 \geq 0,\quad d_1^x, d_2^x \geq 0,\quad d_1^y \geq 0 \end{aligned}$$

$$\begin{cases} \text{入力）} 1\times C = 1\times C \\ \text{出力）} C = 1\times C \end{cases}$$

最適解：$(d_1^{x*}, d_2^{x*}, d_1^{y*}) = (0, 0, 0)$

$$\begin{cases} input)1\times\binom{4}{1} = 1\times\binom{4}{1} + \binom{0}{0} \\ output)\ (1) = 1\times(1) + (0) \end{cases}$$

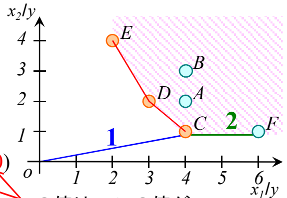
入力余剰・出力不足なし→CはDEA効率的

DEA：CCRモデル

DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	4	4	4	3	2	6
入力2 x_2	2	3	1	2	4	1
出力 y	1	1	1	1	1	1

- 例題2 DMU F についての問題

$$\min.\theta$$
$$\begin{aligned} s.t.\ & 6\theta-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \geq 0 \\ & \theta-(2\lambda_1+3\lambda_2+\lambda_3+2\lambda_4+4\lambda_5+\lambda_6) \geq 0 \\ & (\lambda_1+\lambda_2+\lambda_3+\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)-1 \geq 0 \\ & \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6 \geq 0 \end{aligned}$$



最適解：$\theta^*=1$, $(\lambda_1^*,\lambda_2^*,\lambda_3^*,\lambda_4^*,\lambda_5^*,\lambda_6^*)=(0,0,1,0,0,0)$

Fの値は0でCの値が1

DMU C の入力余剰・出力不足チェック問題

$$\max.(d_1^x+d_2^x)+(d_1^y)$$
$$\begin{aligned} s.t.\ & d_1^x = 1\cdot 6-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \\ & d_2^x = 1\cdot 1-(4\lambda_1+4\lambda_2+4\lambda_3+3\lambda_4+2\lambda_5+6\lambda_6) \\ & d_1^y = (\lambda_1+\lambda_2+\lambda_3+\lambda_4+\lambda_5+\lambda_6)-1 \\ & \lambda_1,\lambda_2,\lambda_3,\lambda_4,\lambda_5,\lambda_6 \geq 0,\quad d_1^x, d_2^x \geq 0,\quad d_1^y \geq 0 \end{aligned}$$

$$\begin{cases} \text{入力）} 1\times F \geqq 1\times C \\ \text{出力）} F \leqq 1\times C \end{cases}$$

最適解：$(d_1^{x*}, d_2^{x*}, d_1^{y*}) = (2, 0, 0)$

$$\begin{cases} input)1\times\binom{6}{1} = 1\times\binom{4}{1} + \binom{2}{0} \\ output)\ (1) = 1\times(1) + (0) \end{cases}$$

入力余剰あり→FはDEA非効率的

優位集合はC（Cに比較して入力余剰2だけ非効率）

DEAの特徴

- 特徴（長所・短所）
  - 他と異なった特徴を持つDMUは，DEA効率的と判断されやすい
    → 他と異なることが良いことの場合は，DEAは良い指標
  - 全てのDEA効率値が大きい値を持つ場合がある
  - DEA効率的と判断されるDMUが非常に多い場合がある

例題（DEAを用いた野球打者評価）

CCRモデルによる

- 2005年度シーズンのセ・パ両リーグ打率上位各30人の打者（計60人）について，DEAにより評価

注：三振は少ない方がよいので入力に…

		打数	三振	安打	打点	四死球	犠打	盗塁
青木宣親	ヤクルト	588	113	202	28	42	19	29
福留孝介	中日	515	128	169	103	94	3	13
金本知憲	阪神	559	86	183	125	101	2	3
金城龍彦	横浜	590	63	191	87	39	13	1
井端弘和	中日	560	77	181	63	78	21	22
岩村明憲	ヤクルト	548	146	175	102	65	5	6
:	:	:	:	:	:	:	:	:

データ（一部加工）
Yahoo!スポーツ プロ野球
個人成績 打率
2006年1月11日3時9分

例題（DEAを用いた野球打者評価）

CCRモデルによる

- 2005年度シーズンのセ・パ両リーグ打率上位各30人の打者（計60人）について，DEAにより評価
  - 結果例：2005年度セ・リーグ打率30位 石井琢朗（横）

    $\langle D_o \rangle$を解いた結果：$\theta=0.8007$, $\lambda_3=0.1638$, $\lambda_5=0.2670$, $\lambda_8=0.1765$, $\lambda_{37}=0.3476$

    ⇒ 各入力）0.8007×石井琢朗 ≧ 0.1638×金本知憲（阪）＋0.2670×井端弘和（中）＋0.1765×赤星憲広（阪）＋0.3476×城島健司（ソ）

    各出力）石井琢朗 ≦ 0.1638×金本知憲（阪）＋0.2670×井端弘和（中）＋0.1765×赤星憲広（阪）＋0.3476×城島健司（ソ）

  - 結果例：2005年度セ・リーグ打率14位 二岡智宏（巨）

    $\langle D_o \rangle$を解いた結果：$\theta=0.9053$, $\lambda_1=0.3890$, $\lambda_3=0.1581$, $\lambda_4=0.0225$, $\lambda_7=0.2917$

    ⇒ 各入力）0.9053×二岡智宏 ≧ 0.3890×青木宣親（ヤ）＋0.1581×金本知憲（阪）＋0.0225×金城龍彦（横）＋0.2917×前田智徳（広）

    各出力）二岡智宏 ≦ 0.3890×青木宣親（ヤ）＋0.1581×金本知憲（阪）＋0.0225×金城龍彦（横）＋0.2917×前田智徳（広）

注：$\langle D_o \rangle$のモデル化，解は cplex9.0 による

生産可能集合とモデル

- 生産可能集合 P からモデルを考察する

入力データ行列 $X = \begin{pmatrix} x_{11} & \cdots & x_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ x_{m1} & \cdots & x_{mn} \end{pmatrix}$

出力データ行列 $Y = \begin{pmatrix} y_{11} & \cdots & y_{1n} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ y_{s1} & \cdots & y_{sn} \end{pmatrix}$

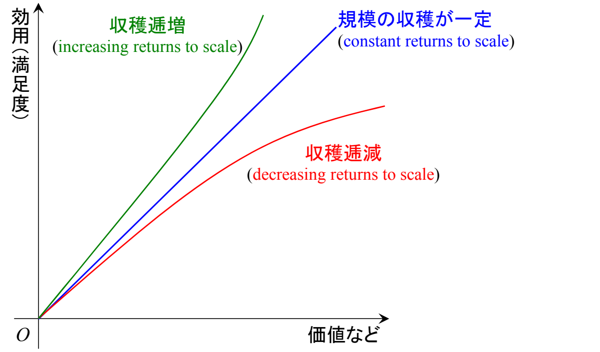
$\boldsymbol{x} = \begin{pmatrix} x_{1\bullet} \\ \vdots \\ x_{m\bullet} \end{pmatrix}$ $\boldsymbol{y} = \begin{pmatrix} y_{1\bullet} \\ \vdots \\ y_{s\bullet} \end{pmatrix}$

$(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$：活動（＝入力と出力の対）
$P=\{(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})\}$：生産可能集合（＝活動の集合）

- 生産可能集合 P に対する仮定（**CCRモデル**）　**規模の収穫が一定** (constant returns to scale)
  （1）現在の各DMUの活動 $(\boldsymbol{x}_i, \boldsymbol{y}_i)$ $(i=1,\ldots,n)$ は P に属する
  （2）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，k倍した活動 $(k\boldsymbol{x}, k\boldsymbol{y})$ も P に属する
  （3）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，$\bar{\boldsymbol{x}} \geq \boldsymbol{x}, \bar{\boldsymbol{y}} \leq \boldsymbol{y}$ を満たす $(\bar{\boldsymbol{x}}, \bar{\boldsymbol{y}})$ も P に属する
  （4）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ の非負結合も P に属する

生産可能集合とモデル

- 「規模の収穫が一定」とは？



注：一般には価値が大きくなるほど，効用の増加量は減る場合が多い．

生産可能集合

$$\min.\ \theta \quad \text{CCRモデル}$$
$$s.t.\quad \theta x_{io} - (x_{i1}\lambda_1 + \cdots + x_{in}\lambda_n) \ge 0 \quad (i = 1,\cdots,m)$$
$$(y_{j1}\lambda_1 + \cdots + y_{jn}\lambda_n) - y_{io} \ge 0 \quad (j = 1,\cdots,s)$$
$$\lambda_1,\ \cdots,\ \lambda_n \ge 0$$

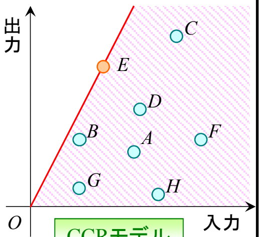
Charnes-Cooper-Rhodes

- 生産可能集合 P に対する仮定（CCRモデル）
  - （1）現在の各DMUの活動 $(\boldsymbol{x}_i, \boldsymbol{y}_i)$ (i=1,…,n) は P に属する
  - （2）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，k倍した活動 $(k\boldsymbol{x}, k\boldsymbol{y})$ も P に属する
  - （3）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，$\bar{\boldsymbol{x}} \ge \boldsymbol{x}, \bar{\boldsymbol{y}} \le \boldsymbol{y}$を満たす $(\bar{\boldsymbol{x}}, \bar{\boldsymbol{y}})$ も P に属する
  - （4）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ の非負結合も P に属する

$$\Leftrightarrow P = \{(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y}) \mid \boldsymbol{x} \ge X\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{y} \le Y\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\lambda} \ge \boldsymbol{0}\}$$

$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo}\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn}\end{pmatrix}\lambda_n \qquad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so}\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn}\end{pmatrix}\lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \ge 0$$



CCRモデル
（1入力・1出力）

生産可能集合

$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo}\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn}\end{pmatrix}\lambda_n \qquad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so}\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn}\end{pmatrix}\lambda_n$$

- ベクトルの線形結合
  - 対象DMUの入力を下から支える

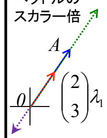
$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o}\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} 2 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1 + \begin{pmatrix} 3 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_2 + \begin{pmatrix} 4 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_3 + \begin{pmatrix} 2 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_4 + \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}\lambda_5 + \begin{pmatrix} 1 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_6$$

例

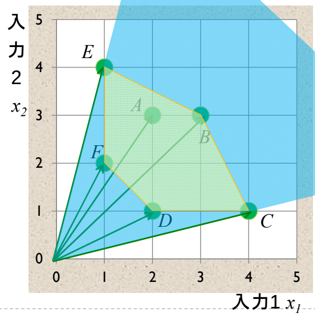
DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	2	3	4	2	1	1
入力2 x_2	3	3	1	1	4	2
出力1 y_1	1	4	3	1	3	2
出力2 y_2	3	2	1	4	3	2

注：入力は小さい方が良い

ベクトルのスカラー倍



$\begin{pmatrix} 2 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1$



6本のベクトルが張る空間
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6$:制限なし → 全空間
  ※）厳密には，基底を含む場合
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$（非負結合） → 錐
  CCRモデル
- $\lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 = 1$（アフィン結合）→超平面
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$,
  $\lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 = 1$（凸結合） → 凸包
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$,
  $L \leqq \lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 \leqq U$（非負・凸の一般化）
  凸包モデル（BCC, DRS, IRS, GRS）
  L,Uの値設定によるバリエーション

生産可能集合

$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo}\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn}\end{pmatrix}\lambda_n \qquad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so}\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1}\end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn}\end{pmatrix}\lambda_n$$

- ベクトルの線形結合
  - 対象DMUの出力を上から押さえる

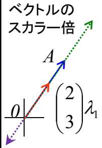
$$\begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o}\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} 1 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1 + \begin{pmatrix} 4 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_2 + \begin{pmatrix} 3 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_3 + \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}\lambda_4 + \begin{pmatrix} 3 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_5 + \begin{pmatrix} 2 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_6$$

例

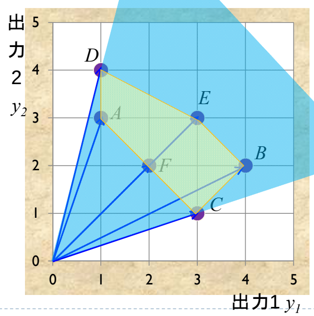
DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	2	3	4	2	1	1
入力2 x_2	3	3	1	1	4	2
出力1 y_1	1	4	3	1	3	2
出力2 y_2	3	2	1	4	3	2

注：出力は大きい方が良い

ベクトルのスカラー倍



$\begin{pmatrix} 2 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1$



6本のベクトルが張る空間
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6$:制限なし → 全空間
  ※）厳密には，基底を含む場合
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$（非負結合） → 錐
  CCRモデル
- $\lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 = 1$（アフィン結合）→超平面
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$,
  $\lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 = 1$（凸結合） → 凸包
- $\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$,
  $L \leqq \lambda_1 + \lambda_2 + \ldots + \lambda_6 \leqq U$（非負・凸の一般化）
  凸包モデル（BCC, DRS, IRS, GRS）
  L,Uの値設定によるバリエーション

生産可能集合とモデル

例

DMU	A	B	C	D	E	F
入力1 x_1	2	3	4	2	1	1
入力2 x_2	3	3	1	1	4	2
出力1 y_1	1	4	3	1	3	2
出力2 y_2	3	2	1	4	3	2

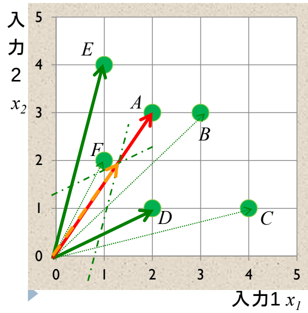
- DEA（CCRモデル）

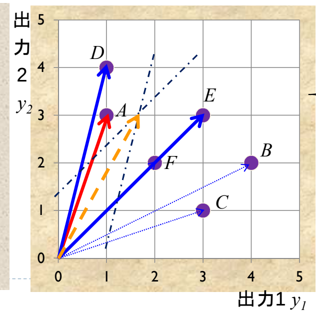
$$\min.\ \theta$$
$$s.t.\quad \theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o}\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} 2 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1 + \begin{pmatrix} 3 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_2 + \begin{pmatrix} 4 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_3 + \begin{pmatrix} 2 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_4 + \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}\lambda_5 + \begin{pmatrix} 1 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_6$$
$$\begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o}\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} 1 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_1 + \begin{pmatrix} 4 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_2 + \begin{pmatrix} 3 \\ 1\end{pmatrix}\lambda_3 + \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}\lambda_4 + \begin{pmatrix} 3 \\ 3\end{pmatrix}\lambda_5 + \begin{pmatrix} 2 \\ 2\end{pmatrix}\lambda_6$$
$$\lambda_1, \lambda_2, \ldots, \lambda_6 \geqq 0$$

DMU Aについて解くと，最適解
θ=0.65625, $\boldsymbol{\lambda}$=(0, 0, 0, 0.46875, 0.375, 0)

$$\begin{cases} input)\ 0.65625\begin{pmatrix} 2 \\ 3\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} 2 \\ 1\end{pmatrix}0.46875 + \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}0.375 \\ output)\ \begin{pmatrix} 1 \\ 3\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} 1 \\ 4\end{pmatrix}0.46875 + \begin{pmatrix} 3 \\ 3\end{pmatrix}0.375 \end{cases}$$

$$\begin{cases} input)\ \begin{pmatrix} 1.313 \\ 1.969\end{pmatrix} \ge \begin{pmatrix} 1.313 \\ 1.969\end{pmatrix} \\ output)\ \begin{pmatrix} 1 \\ 3\end{pmatrix} \le \begin{pmatrix} 1.594 \\ 3.000\end{pmatrix} \end{cases}$$





注:凸包モデルはCCRを含む
（L=0, U=∞ → CCR）

生産可能集合とモデル

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル）

CCRモデルの(2)を一般化する

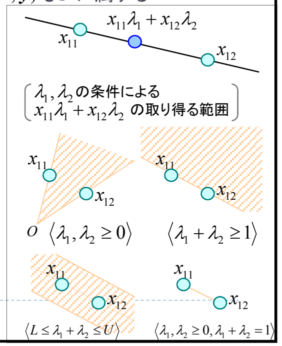
（1）現在の各DMUの活動 (x_i, y_i) (i=1,…,n) は P に属する
（2）P に属する活動 (x, y) に対し，k倍した活動 (kx, ky) も P に属する（kを制限する）
（3）P に属する活動 (x, y) に対し，$\bar{x} \geq x, \bar{y} \leq y$を満たす $(\bar{x}, \bar{y})$ も P に属する
（4）P に属する活動 (x, y) の非負結合も P に属する

$$P = \{(x, y) | x \geq X\lambda, y \leq Y\lambda, \lambda \geq 0, L \leq e\lambda \leq U\}$$

実際の問題はθx_oとy_oを使う

$$\begin{cases} x_1 \geq x_{11}\lambda_1 + x_{12}\lambda_2 + \cdots + x_{1n}\lambda_n \\ x_2 \geq x_{21}\lambda_1 + x_{22}\lambda_2 + \cdots + x_{2n}\lambda_n \\ \vdots \\ x_m \geq x_{m1}\lambda_1 + x_{m2}\lambda_2 + \cdots + x_{mn}\lambda_n \end{cases}, \begin{cases} y_1 \leq y_{11}\lambda_1 + y_{12}\lambda_2 + \cdots + y_{1n}\lambda_n \\ y_2 \leq y_{21}\lambda_1 + y_{22}\lambda_2 + \cdots + y_{2n}\lambda_n \\ \vdots \\ y_s \leq y_{s1}\lambda_1 + y_{s2}\lambda_2 + \cdots + y_{sn}\lambda_n \end{cases}$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0 \qquad L \leq \lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n \leq U$$



生産可能集合とモデル

CCRモデル

$$\begin{array}{ll} \min . \theta & \\ s.t. & \theta x_{io} - (x_{i1}\lambda_1 + \cdots + x_{in}\lambda_n) \geq 0 \quad (i = 1, \cdots, m) \\ & (y_{j1}\lambda_1 + \cdots + y_{jn}\lambda_n) - y_{io} \geq 0 \quad (j = 1, \cdots, s) \\ & \lambda_1, \cdots, \lambda_n \geq 0 \end{array}$$

Charnes-Cooper-Rhodes

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル0：CCRモデル[L=0,U=∞]）

（1）現在の各DMUの活動 (x_i, y_i) (i=1,…,n) は P に属する
（2）P に属する活動 (x, y) に対し，k倍した活動 (kx, ky) も P に属する

規模の収穫一定

（3）P に属する活動 (x, y) に対し，$\bar{x} \geq x, \bar{y} \leq y$を満たす $(\bar{x}, \bar{y})$ も P に属する
（4）P に属する活動 (x, y) の非負結合も P に属する

$$P = \{(x, y) | x \geq X\lambda, y \leq Y\lambda, \lambda \geq 0, L \leq e\lambda \leq U\}$$

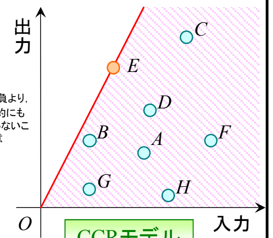
$$\Updownarrow$$

$$e\lambda \geq 0$$

※）λ非負より，何の制約にもなっていないことに注意

$$\theta \begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo} \end{pmatrix} \geq \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn} \end{pmatrix} \lambda_n \quad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so} \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn} \end{pmatrix} \lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0$$



CCRモデル
（1入力・1出力）

生産可能集合とモデル

Banker-Charnes-Cooper

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル1：BCCモデル[L=U=1]）

（1）現在の各DMUの活動 (x_i, y_i) (i=1,…,n) は P に属する
（2）P に属する活動 (x, y) に対し，k倍した活動 (kx, ky) も P に属する

収穫逓減

（3）P に属する活動 (x, y) に対し，$\bar{x} \geq x, \bar{y} \leq y$を満たす $(\bar{x}, \bar{y})$ も P に属する
（4）P に属する活動 (x, y) の非負結合も P に属する

BCCの効率値は一般にCCRより大になる

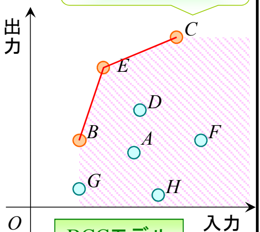
$$P = \{(x, y) | x \geq X\lambda, y \leq Y\lambda, \lambda \geq 0, L \leq e\lambda \leq U\}$$

$$\Updownarrow$$

$$e\lambda = 1$$

$$\theta \begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo} \end{pmatrix} \geq \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn} \end{pmatrix} \lambda_n \quad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so} \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn} \end{pmatrix} \lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0 \qquad \lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n = 1$$



BCCモデル
（1入力・1出力）

生産可能集合とモデル

Increasing Returns to Scale

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル2：IRSモデル[L=1,U=∞]）

（1）現在の各DMUの活動 (x_i, y_i) (i=1,…,n) は P に属する
（2）P に属する活動 (x, y) に対し，k倍した活動 (kx, ky) も P に属する

収穫逓減

（3）P に属する活動 (x, y) に対し，$\bar{x} \geq x, \bar{y} \leq y$を満たす $(\bar{x}, \bar{y})$ も P に属する
（4）P に属する活動 (x, y) の非負結合も P に属する

比較的規模の小さい活動の効率性を重視

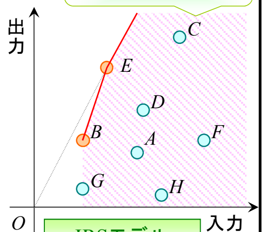
$$P = \{(x, y) | x \geq X\lambda, y \leq Y\lambda, \lambda \geq 0, L \leq e\lambda \leq U\}$$

$$\Updownarrow$$

$$e\lambda \geq 1$$

$$\theta \begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo} \end{pmatrix} \geq \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn} \end{pmatrix} \lambda_n \quad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so} \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1} \end{pmatrix} \lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn} \end{pmatrix} \lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0 \qquad \lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n \geq 1$$



IRSモデル
（1入力・1出力）

生産可能集合とモデル

Decreasing Returns to Scale

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル3：DRSモデル[L=0,U=1]）

（1）現在の各DMUの活動 $(\boldsymbol{x}_i, \boldsymbol{y}_i)$ $(i=1,\ldots,n)$ は P に属する

（2）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，k倍した活動 $(k\boldsymbol{x}, k\boldsymbol{y})$ も P に属する

（3）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，$\bar{\boldsymbol{x}} \geq \boldsymbol{x}, \bar{\boldsymbol{y}} \leq \boldsymbol{y}$を満たす $(\bar{\boldsymbol{x}}, \bar{\boldsymbol{y}})$ も P に属する

（4）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ の非負結合も P に属する

収穫逓減

比較的規模の大きい活動の効率性を重視

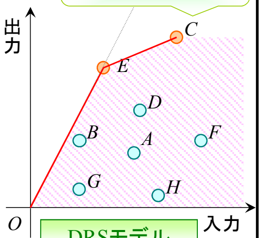
$$P = \{(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y}) \mid \boldsymbol{x} \geq X\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{y} \leq Y\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\lambda} \geq \boldsymbol{0}, L \leq \boldsymbol{e\lambda} \leq U\}$$

$$\Updownarrow$$

$$\boldsymbol{e\lambda} \leq 1$$

$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo} \end{pmatrix} \geq \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1} \end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn} \end{pmatrix}\lambda_n \quad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so} \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1} \end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn} \end{pmatrix}\lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0 \qquad \lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n \leq 1$$



DRSモデル
（1入力・1出力）

生産可能集合とモデル

現存の活動の規模をある程度縮小拡大したものまで認める立場

General Returns to Scale

- 生産可能集合 P に対する仮定（凸包モデル4：GRSモデル[L≦1,U≧1]）

（1）現在の各DMUの活動 $(\boldsymbol{x}_i, \boldsymbol{y}_i)$ $(i=1,\ldots,n)$ は P に属する

（2）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，k倍した活動 $(k\boldsymbol{x}, k\boldsymbol{y})$ も P に属する

（3）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ に対し，$\bar{\boldsymbol{x}} \geq \boldsymbol{x}, \bar{\boldsymbol{y}} \leq \boldsymbol{y}$を満たす $(\bar{\boldsymbol{x}}, \bar{\boldsymbol{y}})$ も P に属する

（4）P に属す活動 $(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y})$ の非負結合も P に属する

収穫逓減

BCCの生産可能集合を拡大
効率値はBCCより悪い

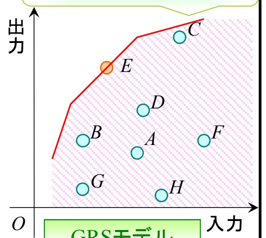
$$P = \{(\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y}) \mid \boldsymbol{x} \geq X\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{y} \leq Y\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\lambda} \geq \boldsymbol{0}, L \leq \boldsymbol{e\lambda} \leq U\}$$

$$\Updownarrow$$

$$ex)\, 0.8 \leq \boldsymbol{e\lambda} \leq 1.2$$

$$\theta\begin{pmatrix} x_{1o} \\ x_{2o} \\ \vdots \\ x_{mo} \end{pmatrix} \geq \begin{pmatrix} x_{11} \\ x_{21} \\ \vdots \\ x_{m1} \end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} x_{1n} \\ x_{2n} \\ \vdots \\ x_{mn} \end{pmatrix}\lambda_n \quad \begin{pmatrix} y_{1o} \\ y_{2o} \\ \vdots \\ y_{so} \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} y_{11} \\ y_{21} \\ \vdots \\ y_{s1} \end{pmatrix}\lambda_1 + \cdots + \begin{pmatrix} y_{1n} \\ y_{2n} \\ \vdots \\ y_{sn} \end{pmatrix}\lambda_n$$

$$\lambda_1, \lambda_2, \cdots, \lambda_n \geq 0 \qquad 0.8 \leq \lambda_1 + \lambda_2 + \cdots + \lambda_n \leq 1.2$$



GRSモデル
（1入力・1出力）

参考文献

[1] A. Charnes, W.W. Cooper, and E. Rhodes, ``Measuring the Efficiency of Decision Making Units'', *European Journal of Operational Research*, *Vol.2, pp.429-444*, 1978

[2] 刀根薫「経営効率性の測定と改善～包絡分析法DEAによる～」日科技連（1993）

[3] 末吉俊幸「DEA～経営効率分析法～」朝倉書店（2001）

[4] 森雅夫・松井知己「オペレーションズ・リサーチ」朝倉書店（2004）

[5] …