

# 多段階のプレーヤーの意思決定に基づく サプライチェーン全体の在庫量変動に関する考察

—需要が安定している場合の多段階の意思決定とブルウィップ効果—

富山県立大学工学部電子・情報工学科  
1515010 大谷和樹

指導教員：奥原浩之

## 1 はじめに

サプライチェーンの内部には、川上から川下までの間に複数の段階が介在し、利害関係が異なる構成員が含まれているのが一般的である。サプライチェーン全体を通して提供される製品に関して、各プレーヤーが、その品質、品揃えの幅、サービス水準をどの程度の設定するかによって、サプライチェーン全体の利益が左右されることになる。このような状況を踏まえて、Gopal and Cahill(1992) はサプライチェーン・マネジメント（以下、SCM と略す）の主要な取り組みは、サプライチェーン内部の利害を調整しながら、サプライチェーン内部のトレードオフをコントロールすることであるとしている。Lee et al.(1997) は SCM が抱える最大の課題の一つとして、ブルウィップ効果を挙げている。

本稿では、トレンドや周期性などがなく、需要が安定した商品に限定して、最適な安全在庫水準の存在及びその値を仮定し、サプライチェーンメンバーの各プレーヤーがどのように在庫目安を設定し、各プレーヤーの意思決定の結果がサプライチェーン全体にどのような影響を与えるかについてシミュレーションを行う。

## 2 モデルの設定と各プレーヤーの部分最適に基づく意思決定

本稿では、サプライチェーンを、上流から、メーカー（協力企業含む）、卸売り、小売り（消費者含む）の3段階に区分けして考察を進める。

各プレーヤーは、販売と補充（発注と受領）を繰り返すが、在庫が品切れを防ぐのに重要な働きをしているのは言うまでもない。図1は、各プレーヤーが最大在庫目標水準を設定し、定期的に発注する場合の典型的な在庫変動の様子を表している。各プレーヤーは定期発注方式[ $(s, t)$ 方式]を採用し、売れ残りと品切れから発生する損失およびリードタイムを考慮しながら、発注目安( $T$ )を設定し、特定の間隔で発注するとする。

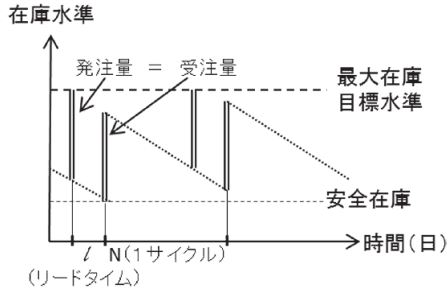


図1 在庫調整期間における在庫水準の推移

小売りや卸売りの場合、粗利益の総額から品切れコストや在庫コストなどの費用を控除した額を最大にするように、安全在庫を含む在庫水準や発注間隔などを決定する。発注期間を $N$ 日、そして商品の注文から受領までのリードタイムを $L$ 日とする。さらに、 $(N+L)$ 日間の需要を $q$ 、発注目安を $T$ とした場合、品切れ確率( $\beta$ )は数式(1)のように表される。

$$\beta = \int_T^{\infty} \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma^2} \exp\left(-\frac{(q-\mu)^2}{2\sigma^2}\right) dq \quad (1)$$

但し、 $T$ は最大在庫目標水準で $(N+L)$ 間の需要予測に安全在庫を加えたもの、 $q$ は $(N+L)$ 日間の需要、 $\mu$ は $q$ の平均値、 $\sigma$ は $q$ の標準偏差である。

発注間隔( $N$ 日)や商品の注文から受領までのリードタイム( $L$ 日)を所与として、最適な $T$ は以下の数式(2)で表される $\Pi$ を最大化する値を求めることによって特定することができる。

$$\Pi = (1-\beta)(p-c)q - \beta[(p-c)T - s(q-T)] - (N+L)\left(\frac{N}{N+L} \times \frac{q}{2} + k\sigma\sqrt{N+L}\right)h \quad (2)$$

但し、 $p$ は販売価格、 $c$ は仕入れ価格、 $s$ は一個当たりの品切れコスト、 $k$ は安全係数、 $h$ は製品一個の一日当たり保管コストである。

(2)式から、粗利益の総額から品切れコストと在庫の保管費用を控除したものを最大化するように、 $k$ を設定することによって、 $T$ や $\beta$ も特定することができる。

小売りや卸売りの段階では、製造工程は含まれないので、小売りや卸売りの最大化の方法は基本的の同じ構造となる。数多くの小売りからの注文を集約しているのが卸売りであるので、小売りから卸売りへの注文量(需要)の期待値は小売りの需要の販売量の総和となる。各小売り間の需要が独立であると仮定した場合、卸売りへの注文の分散は、各小売りの分散の総和となる。

工場では、在庫管理活動に加えて、製造工程が含まれるので、設備投資、従業員の採用・訓練、原材料の調達(リードタイム)、加工時間など、小売りや卸売りとは異なる要素が含まれるようになる。ひとつの生産ラインで複数の製品を製造している場合、段取りの回数を絞込むことによって、時間やコストを削減するのが一般である。工場が保持している完全品在庫には、サイクル在庫や安全在庫に加えて、少ない段取り回数やロットサイズの大きさを生じる過剰な在庫が含まれることになる。したがって、 $(N+L)$ 日間の在庫調整期間における製造コストを加味したものととして、工場側の利潤は数式(3)として表現できる。

$$\Pi = (1-\beta)(p-c)q - \beta[(p-c)T' - s(q-T')] - \left(\frac{Nq}{2} + (N+L)k\sigma\sqrt{N+L}\right)h - [f + v(n)]q \quad (3)$$

但し、 $f$ は製品一個当たり固定費の配賦額、 $v(N)$ は製品一個当たり変動費用(段取り費用含む)、 $T'$ はロットサイズの端数分だけ $T$ より大きくなる。

数多くの卸売りからの注文を集約しているのが工場であるので、卸売りから小売りへの注文量(需要)は卸売りの需要の販売量の総和となる。各卸売り間の需要が独立であると仮定した場合、工場への注文の分散は、各卸売りの分散の総和である。

## 3 R統計ソフトによるモデル構築

本研究では、R統計ソフトを活用する。図2は本研究で用いるようお箱の関係を図示したものである。行列形式で表現されるものには4つのアルファベットの太文字から構成されている。左側の2つのアルファベットがC(消費者)、R(小売り)、W(卸売り)、M(工場)の組み合わせであり、川上から川下までのどの部分での出来事かを示している。そして右半分が項目の説明で、IN(在庫)とTS(在庫目安)を意味し、D(需要)に付随するものは、G(乱数)、S(サンプル)、O(注文)、P(サイクル)を意味する。最適な危険係数( $K$ )は、数式(2)から求めるべきであるが、そのために多くの仮定が必要となるので、その過程を省略して、最適な危険係数( $K$ )を2.33(品切れ確率1%)とする。さらに、サイクルタイム( $N$ )は3日、リードタイム( $L$ )は1日とし、サプライチェーンの各プレーヤーは同期して活動を行うものとする。

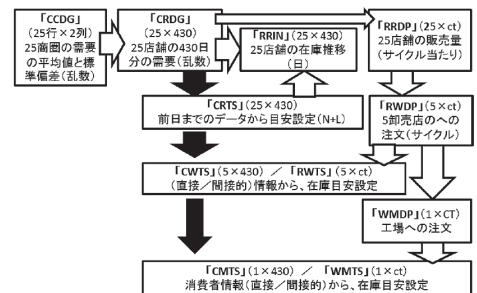


図2 モデル内の要素の関係図

「CCDG」は25地域の商圏に関する需要の平均値と標準偏差を行列形式で表したものである。CCDGの数値は乱数(正規)から発生させて

いる。その中身は 25 行 (商圏) × 2 列の行列で、需要の平均値 (平均 100, 標準偏差 10) と標準偏差 (平均 10, 標準偏差 3) を用いて、数式 (4) の形で特定している。次に、「CRDG」は CCDG で特定した平均と標準偏差を基に、数式 (4) のように、乱数 (正規) を発生させ、それらを一の位で四捨五入し、25 行 (小売店舗) × 430 列 (日) の行列を作成したものである。

```
> x <-0
> for(i in 1:25)x >-x+1
+CCDG[x,1] <-rnorm(1,100,10) *CCDG の 1 列目
+CCDG[x,2] <-rnorm(1,10,3) *CCDG の 2 列目
+CRDG[x,] <-round(rnorm(430,CCDG[x,1],CCDG[x,2])) *CRDG
```

「CRTS」は CRDG の前日までのデータから各小売りの平均需要 (日) や標準偏差 (日) を特定し、在庫目安を算出したものである。在庫目安は、森田 (2004) に基づいて、サイクルタイム (発注間隔) にリードタイムを考慮した日数の平均需要に、危険係数 (K) × 標準偏差 × (サイクルタイム + リードタイム) ^ 0.5 を加えたもので、数式 (5) のように表すことができる。

```
x <-0
> for(i in 1:25)x <-x+1
+yy <-0
+for(jj in 2:430)yy <-yy+1
+CRTS[x,yy] <-round((N+L)*mean(CRDG[x,1:yy-1])
+K*sd(CRDG[x,1:yy-1])*(N+L)0.5))}
```

「RRIN」は在庫目安 S (CRTS) から発注後 N 日内の販売数量を差し引いたもので在庫保有量になり、数式 (6) の前半部分のように表すことができる。そして、「RRDP」は一サイクル内での販売数量を集約したもので、数式 (6) の後半部分のように表すことができる。

```
> ct <-420/N *ct はサイクル数 (整数)
> x <-0
> for(i in 1:25)x <-x+1
+y <-0
+for(j in 1:ct)y <-y+1
+ll <-(y-1)*N+11 *各サイクルの始まり
+RRDP[x,y] <-sum(CRDG[x,ll:ll + N-1])
+z <-0
+for(m in 1:N)z <-z+1
+ul <-ll+z-1 各サイクルの終わり
+RRIN[x,ul] <-CRTS[x,3]-sum(CRDG[x,ll:ul])
```

「RWDP」は各卸売り店が各サイクル中に 5 店舗から受けた注文を集約したものである。そして「RWTS」は卸売り店からの受注 (RWDP) に基づいて設定する在庫目安であるので、数式 (7) のように表すことができる。「CWTS」も RWTS と同様に卸売り店の設定する在庫目安であるが、CWTS は前日までの販売データを小売店と共有している場合なので、CRDG (CRTS を卸売り店単位で集約したもの) から各卸売りの在庫目安を算出しているので、数式 (8) のように表すことができる。CMTS (工場での在庫目安) も同様に算出することが可能である (数式 (8) の最終式)。

```
> y <-0
> for(j in 1:ct)y <-y+1
+xx <-0
+for(ii in 1:5)xx <-x+1
+llp <-(-xx-1)*5+1
+ulp <-llp+4
+RWDP[xx,y] <-sum(RRDP[llp:ulp,y])
+RWTS[xx,y] <-round(mean(RWDP[xx,1:y-1])*(N+L)/N
+K*sd(RWDP[xx,1:y-1])*((N+L)/N)0.5) > yy
<-0
> for(jj in 1:430)yy <-yy+1
+xx <-0
+for(ii in 1:5)xx <-x+1
+llp <-(-xx-1)*5+1
+ulp <-llp+4
+cwts[xx,yy] <-sum(CRDG[llp:ulp,yy])
```

```
+CWTS[xx,yy] <-round(mean((cwts[xx,1:yy-1]))*(N+L)
space30mm + sd(cwts[xx,1:yy-1])*K*(N+L)0.5)
+cmts[1,yy] <-sum(CRDG[,yy])
+CMTS[1,yy] <-round(mean(cmts[,1:yy-1])*(N+L) + sd(cmts[,1:yy-1])
*K*(N+L)0.5)
```

「WMDP」は卸売りから工場へのサイクル単位での注文であるので、RWDP を集約したものとなる。そして WMDP のデータを基に在庫目安を算出したのが「WMTS」となる。両者は数式 (9) のように表現することができる。

```
> y <-0
> for(j in 1:ct)y <-y+1
+WMDP[1,y] <-sum(RWDP[1:5,y])
+WMTS[1,y] <-round(mean(WMDP[1,1:y-1])*(N+L)/N
+K*sd(WMDP[1,1:y-1])*((N+L)/N)0.5)
```

工場の場合は、生産能力や生産効率などに起因する問題があるので、最適なサイクル (N) に関しては幅を持たせる必要がある。工場のサイクルの日数を 1 日から 7 日 (ラグを考慮すると 2 日から 8 日) の在庫目安の推移は、数式 (10) のように表すことができる。

```
> zz <-0
> for(mm in 1:7)zz <-zz+1
> yy <-0
> for(jj in 1:430)yy <-yy + 1
+CMTS[zz,yy] <-round(mean(cmts[,1:yy-1])*(zz+L) + sd(cmts[,1:yy-1])
*K*(zz+L)0.5)
```

4 分析結果

在庫目安の設定が注文時に重要な働きをするので、理想的な在庫目安に到達するまでの時間とプロセスに注目して、結果の説明をする。CRTS は前日までの消費の購入情報に基づいて、在庫目安を日々更新していくものである、表 1 では、CRDG から 430 日分のデータを基に算出した理想的な在庫目安の ± 8 % 範囲内に収まり続けるようになった最初の日数が示されている。25 件の小売りの中で、17 件ほどがサンプル対象期間の 10 日以内に収まるようになったが、残りの 8 件は収まっていなかった、RRIN は、140 回のサイクル (420 日) 中に小売りの保有する在庫水準の最大と最小値を示している。

表 1 消費者と小売りレベルの需要と在庫情報

CRDG (430 日分の需要情報)				RRDP (140 回分)		CRTS		RRIN (140 回)		
商圏	平均値	標準偏差	在庫目安	平均値	標準偏差	理論値	±5%内	最大	最小	
小売店 (1)	111.6	11.0	497.6	334.6	18.3	497.6	6	394	83	
小売店 (2)	108.8	12.8	494.7	326.1	20.2	494.7	32	426	119	
小売店 (3)	93.1	7.7	407.9	279.0	12.8	407.9	3	332	93	
小売店 (4)	117.4	6.9	502.1	352.3	12.7	502.1	5	377	93	
小売店 (5)	94.1	8.4	415.3	282.0	14.1	415.3	3	337	93	
小売店 (6)	94.8	10.3	427.1	284.4	17.9	427.1	7	320	64	
小売店 (7)	88.1	8.3	390.8	264.2	14.8	390.8	4	350	108	
小売店 (8)	103.3	5.7	439.5	309.7	9.6	439.5	3	359	110	
小売店 (9)	94.8	9.1	421.7	284.4	16.1	421.7	10	336	84	
小売店 (10)	91.9	7.6	403.2	276.0	13.5	403.2	9	326	93	
小売店 (11)	89.0	12.9	416.0	266.9	21.5	416.0	11	342	53	
小売店 (12)	91.3	7.3	399.4	273.9	12.7	399.4	3	341	105	
小売店 (13)	86.6	13.4	408.9	260.0	22.6	408.9	17	378	115	
小売店 (14)	101.6	13.1	467.2	304.0	21.1	467.2	13	395	101	
小売店 (15)	109.0	8.4	475.2	327.5	14.6	475.2	24	411	130	
小売店 (16)	97.3	5.4	414.3	291.9	9.2	414.3	3	337	108	
小売店 (17)	92.8	14.1	437.0	278.2	25.9	437.0	10	328	31	
小売店 (18)	105.1	12.5	478.9	315.4	23.9	478.9	7	344	31	
小売店 (19)	100.3	12.7	460.4	301.0	20.1	460.4	4	452	153	
小売店 (20)	104.5	5.1	442.0	313.9	8.2	442.0	5	311	67	
小売店 (21)	79.6	13.2	380.0	238.6	23.9	380.0	18	351	97	
小売店 (22)	98.6	8.5	434.3	296.1	15.6	434.3	20	292	32	
小売店 (23)	89.7	11.0	410.1	269.1	19.2	410.1	8	327	45	
小売店 (24)	92.5	5.5	395.5	277.6	10.1	395.5	5	276	46	
小売店 (25)	104.9	10.8	470.2	315.2	19.8	470.2	16	388	97	
合計	2,440.7		10,889.1	7,321.8						

※在庫目安は 4 (N=3、L=1) 日分の在庫目標

表 2 の上段は卸売りレベルで集約した一サイクル当たりの需要と在庫目安の推移を示したものである。CWTS は消費者の前日までの購買情報を共有して在庫目安を算出したものであるのに対し RWTS は小売りから集約されたサイクル単位からの注文から在庫目安を算出したものである。新の情報に更新するためには、一期遅れが生じ、さらに標準偏差を算出するのに少なくとも 2 つ以上のデータが必要であるので最短

でも3日あるいは3回となる。集約を進めることにより、小売店単位や一日単位の平均需要は、数式(11)で示しているように分散が小さくなるので、期待値付近に収まりやすくなる。

(11) 
$$V(\sum D_n / \bar{N}) = E(\sum D_n - \mu_{\bar{N}})^2 = V(\sum D_n) / \bar{N}^2 = \sum [V(D_n)] / \bar{N}^2$$
からは、トレンドや周期性などが無い場合は、分散している小売りからの注文を卸売りレベルに集約、さらに工場レベルに集約することによって需要の安定性が増した。このことは中心極限定と一致している。

直接的な情報を活用しなくても、集約されたデータを用いることによって、理想的な値に収まりやすくなる。同様のことは、表2の下段に示されている工場レベルでも言える。

表2 卸売りと工場レベルの需要と在庫情報

	RWDP (140回)			在庫目安	CWTS(日)	RWTS(回)
	平均値	最大	最小	理論値	±5%範囲内 (以降)	
卸売り(1)	1,574	1,664	1,463	2,200	3	3
卸売り(2)	1,419	1,499	1,340	1,978	3	3
卸売り(3)	1,432	1,547	1,326	2,028	5	4
卸売り(4)	1,500	1,648	1,378	2,112	5	3
卸売り(5)	1,397	1,486	1,287	1,967	3	5
工場	RWDP (140回)			在庫目安	CMTS(日)	RMTS(回)
	平均値	最大	最小	理論値	±1%範囲内 (以降)	
工場	7,322	7,510	7,121	9,997	8	3

表3では、工場レベルでは、生産活動や調達時間などによって、最適な生産間隔が異なる場合があるので、生産間隔が1日~1週間(リードタイム1日を考慮して2~8日)の場合の更新される在庫目安を理論値で除したものの推移を比較したものである(%で表記)。サイクル間隔が長くなればなるほど、理論値付近で安定的に推移することになる。数式(11)で示したように、工場レベルのように集約が進んだ場合、期待値付近に収束することになる。

表3 工場レベルのサイクル感覚が異なる場合の在庫目安の推移

CMTSs	理論値	最大	最小	範囲
2日(N=1)	5046	100.8%	98.1%	2.7%
3日(N=2)	7523	100.7%	98.5%	2.2%
4日(N=3)	9995	100.7%	98.7%	2.0%
5日(N=4)	12463	100.6%	98.8%	1.8%
6日(N=5)	14929	100.6%	98.9%	1.7%
7日(N=6)	17392	100.6%	99.0%	1.6%
8日(N=7)	19854	100.6%	99.1%	1.5%

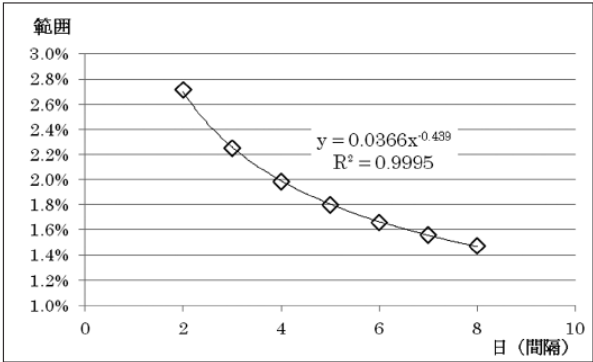


図3 工場レベルでのサイクル間隔と在庫目安の幅

5 おわりに

ブルウィップ効果は、サプライチェーン内の多段階のプレイヤーが各自にとって最適な バッチサイズや発注間隔などを設定することによって、需要情報の歪みが生じ、その歪み がサプライチェーンを遡りながら増幅されていく現象であると説明されることが多い。確かに、小売りから卸売りあるいは卸売りから工場への注文があった日とそうでない日などを日単位で考えれば、川上に

遡るほど変動が大きくなると言えるかもしれない。しかし、各プレイヤーは最適なサイクル(発注間隔)を設定しているので、彼らの抱える需要をサイクル単位で捉える必要がある。本研究は、トレンドや周期性などが無い場合は、分散している小売りからの注文を卸売りレベルに集約、さらに工場レベルに集約することによって需要の安定性が増した。このことは中心極限定と一致している。

本研究では、安定した需要下で、適正なマネジメントを行っていれば、ブルウィップ効果の悪影響がほとんど表面化しないことを確認した。しかし、今後は、ブルウィップ効果を検証するために、需要に周期性やトレンドなどを付与するかあるいはサプライチェーン 内部のマネジメントの問題として歪みや遅れを想定し、更なる研究を進める予定である。

参考文献

[1] 森田道也 (2004)『サプライチェーンの原理と経営』, サイエンス社.

[2] Bradley, P. J., Thomas, T. G., Cooke, J. ( 1999) . Future Competition: Supply Chain vs. Supply Chain. Logistics Management and Distribution Report, 39 (3) , 20-21.

[3] Goldratt, E. M. and Cox, J. ( 1992) . The Goal: A Process of Ongoing Improvement. Second Rev. Ed. Croton-on-Hudson, NY: North River Press.

[4] Gopal, C. and G. Cahill ( 1992) , Logistics in Manufacturing, Homewood, IL: Business One Irwin.

[5] Lee, H. L., Padmanabhan, V., Whang. S. ( 1997) . Information distortion in a supply chain: The bullwhip effect. Management Science, 43 (4) , 546-558. 533-563, 1999.

[6] Sunil, C. Meindl, P. ( 2001) . Supply Chain Management. New Jersey, NJ: Prentice Hall.