

数理・統計ファイナンスの研究・教育拠点形成に向けた活動

(Towards a hub of activities for research and education on mathematical and statistical finance)

研究成果（800 字程度．図表可）：

（１）海外研究者来訪・滞在

- ・ Freddy Delbaen (ETH Zurich, Emeritus Prof.): 2012. 8. 31--9. 21.

大阪大学金融保険センター主催国際ワークショップ参加後、大阪大学に滞在。情報意見交換、プライベートセミナー等を実施した。

- ・ 一場知之 (University of California, Santa Barbara, Assistant Prof.): 2012. 8. 22--9. 22.

大阪大学金融保険センター主催国際ワークショップに参加後、本研究科で集中講義実施。共同研究に関して議論・意見交換を行った。

- ・ Jin Feng (University of Kansas, Associate Prof.): 2013. 1. 27--1. 29.

未来ラボセミナーで講演（後述）、共同研究に関して議論・意見交換実施。

- ・ Huyen Pham (University Paris Diderot (Paris VII), Professor): 2013. 2. 11--2. 12.

- ・ Wolfgang Runggaldier (University of Padova, Italy, Professor): 2013. 2. 11--2. 12.

・ Daniel Hernandez-Hernandez (Centro de Investigacion en Matematicas, A.C., Mexico, Professor): 2013. 2. 11--2. 12.

国際ワークショップに参加（後述）、その他情報意見交換を行った。

（２）国際ワークショップ

“Two Day Workshop, Workshop on Finance, Stochastics and Asymptotic Analysis” 運営費用補助を未来ラボ予算から行った：

- ・ 期日：2013 年 2 月 11--12 日，
- ・ 開催場所：大阪大学金融保険教育研究センター，
- ・ 運営責任者：関根順・山崎和俊(大阪大学)，長井英生(関西大学)．
- ・ 講演者：K. Fujimoto (MUFU), M. Fukasawa (Osaka), D. Hernandez-Hernandez (CIMAT), N. Ichihara (Hiroshima), T. Kato (Osaka), H. Nagai (Kansai), S. Ogawa (Ritsumeikan), H. Pham (Paris), W. Runggaldier (Padova), J. Sekine (Osaka), K. Yamazaki (Osaka).
- ・ 参考 URL:

<http://www-csfi.sigmath.es.osaka-u.ac.jp/structure/activity/workshop.php?id=14>

（３）国内研究集会

「第 2 回数理ファイナンス合宿型セミナー」運営の補助を未来ラボ予算から行った：

- ・ 開催期日：2012 年 11 月 2--4 日
- ・ 開催場所：大橋会館(東京)

・運営責任者：深澤正彰(大阪大学)，中川秀敏(一橋大学)。

・招待講演者：内田善彦（日本銀行），加藤恭（大阪大学），楠岡成雄（東京大学），関根順（大阪大学），高岡浩一郎（一橋大学），高田英行（東邦大学），藤本一文（三菱東京UFJ銀行），松本浩一（九州大学）。

・ショートコミュニケーション講演者：足立高德（一橋大学），泉優行（九州大学），榎本拓実（京都大学），大須賀恵実（東北大学），荻原哲平（大阪大学），尾張圭太（東京大学），Ngo Hoang-Long（立命館大学），佐々木洋（一橋大学），篠崎裕司（東京工業大学），須田真太郎（東北大学），瀧野一洋（名古屋商科大学），田中秀幸（立命館大学），中津智則（立命館大学），中原健二（BNPパリバ証券），畑宏明（静岡大学），孕石匡弘（日本銀行），山口武彦（立命館大学），山田俊皓（三菱UFJトラスト投資工学研究所），山中卓（三菱UFJトラスト投資工学研究所），劉天（東北大学）。

・参考URL：<http://www.math.sci.osaka-u.ac.jp/~fukasawa/seminar.html>

（４）セミナー：制御理論と数理ファイナンスに関するトピックスでセミナーを実施した。

（運営責任者：貝瀬秀裕・加嶋健司）

○第一回未来ラボセミナー

・開催期日：2013年1月29日

・開催場所：基礎工学部J棟617号室

・講演者：Jin Feng (University of Kansas)

・タイトル：“Viscosity solution theory for first order Hamilton-Jacobi equation in metric spaces”。

研究経費（H23年度）の内訳

備品費	消耗品費	旅費	謝金	その他	合計
37548 円	0 円	309920 円	54000 円	98532 円	500000 円

共同研究者等

一場知之(University California, Santa-Barbara)，Jin Feng(University of Kansas)

参考となるHP等

<http://www-csfi.sigmath.es.osaka-u.ac.jp/structure/activity/workshop.php?id=14>

<http://www.math.sci.osaka-u.ac.jp/~fukasawa/seminar.html>

<https://docs.google.com/viewer?a=v&pid=sites&srcid=ZGVmYXVsdGRvbWFpbmxqdW5zZWtpbmV8Z3g6NjZmNzY5ZWVjY2I2Y2NjNg>