

## オペレーションズリサーチ学会北海道支部

### サマースクール 2015

日時: 2015年8月5日(水), 6日(木)

場所: 稚内総合文化センター

参加費: 5000円(学生会員無料, 学生非会員1500円, 発表者もご負担下さい, 学会より領収書を発行します)

申し込み: 不要

#### 8月5日(水)

10:00 - 11:00 “Monopolistic Dealer versus Broker: Impact of Proprietary Trading with Transaction Fees, (仮)” 西出勝正, 横浜国立大学

11:00 - 12:00 “Discretization of vol-of-vol expansion (仮)”, 山田俊皓, 一橋大学

13:30 - 14:30 「為替レートに対する連続制御と制限をおいた確率インパルス制御 (仮)」安田和弘, 法政大学

14:30 - 15:30 “Investment timing, collateral, and financing constraints (仮)” 芝田隆志, 首都大学東京

15:30 - 16:00 ”Optimal decision for hostile takeover”, 陳文君, 北海道大学

16:00 - 16:30 未定

#### 8月6日(木)

10:00 - 12:00 Lecture “Financial Calculus: An introduction to derivative pricing” 陳文君, 北海道大学

13:30 - 16:00 同上

内容: Baxter and Rennie による同名のテキストを用いて, ファイナンスに利用される確率過程に関する基礎を講義し, ブラックショールズモデルの導出を行う.