

○ ワークショップ「最適停止問題」

開催責任者 経営学部 姜秉国

2004年7月30日、31日

南山大学名古屋キャンパス J棟 J 54 教室

ワークショップは参加者 13 名、以下のプログラムで開催された。

◇報告者及び題目

- ・孫 在東(筑波大学) 「Customers Selection Problem with Idling Profit」
- ・Ee Mong Shan(筑波大学) 「Newsboy Problem with Pricing Policy」
- ・鈴木淳生(南山大学) 「The Pricing of Perpetual Game Options」
- ・八木恭子(南山大学) 「The Optimal Strategies and Boundaries of Callable Convertible Bonds」
- ・澤木勝茂(南山大学) 「The Valuation of Callable American Options」
- ・玉置光司(愛知大学) 「An Optimal Multiple Selection Problem with Partial Recall Based on Relative Ranks」
- ・生田誠三(筑波大学) 「An Integration of the Optimal Stopping Problem and the Optimal Pricing Problem」
- ・斉藤 毅(愛知大学) 「Optimal stopping problem with reservation」
- ・姜 秉国(南山大学) 「A Strategic Game and Optimal Decision Rule」
- ・全体会議 「今後の研究課題について」

◇ワークショップの討論内容

本ワークショップは最適停止問題の研究者として有名な筑波大学の生田先生、愛知大学の玉置先生、南山大学の澤木先生をお招きし、近年の研究成果の一部を披露してもらう場を設け、若手研修者に刺激を与える機会にすることを目的として開かれた。全発表者の発表内容は理論から実証まで幅広い分野のものとなった。三人の先生からは若手研究者の発表内容について貴重な意見を頂くことができた。

◇研究成果発表

報告者が各自、学術誌などに論文を投稿・発表する。