

2008年3月14日

教職員 各位

南山大学数理情報研究センター  
センター長 伏見 正則  
南山大学経営研究センター  
センター長 白木 俊彦

### 講演会開催のお知らせ

南山大学数理情報研究センター・経営研究センター共催で以下の講演会を開催いたします。ご多忙中とは存じますが、ぜひご参加いただきますよう、ご案内申し上げます。

#### 記

日 時：2008年4月10日（木）午後2時～午後4時30分  
場 所：南山大学サテライトキャンパス 6階 TS62 教室  
講 師：董 晶輝 准教授（東洋大学経営学部会計ファイナンス学科）  
飯原 慶雄 名誉教授（南山大学）  
テーマ：有限回数の参入退出問題

#### 講演概要：

Dixit and Pindyck(1994)では、幾何ブラウン運動での投資決定問題について、一回きりの参入モデルのほか、参入と退出を無限に繰り返す参入退出モデルが扱われている。この研究では、参入と退出の回数が有限であるときの参入退出モデルについて検討する。幾何ブラウン運動について、参入と退出の回数が有限である場合の解を求めるとともに、解を求めるための方程式の性質を明らかにする。さらに、ブラウン運動にジャンプを加えた跳躍拡散過程について有限回の参入退出モデルの解を求める。また、数値例を用いて、参入・退出の回数が参入と退出の閾値およびプロジェクトの価値に及ぼす影響について検証する。

以上

#### 【本件問い合わせ先】

南山大学数理情報学部事務室  
内線：6100