

文部科学省私立大学オープン・リサーチ・センター整備事業
立命館大学フロンティアシンポジウム

確率過程論と

数理ファイナンスへの

応用

— Stochastic Processes and Applications to Mathematical Finance —

●日時 2006年3月6日(月)～3月10日(金)

●場所 立命館大学びわこ・くさつキャンパス
3月6日(月)～3月8日(水) ローム記念館5階大会議室
3月9日(木)～3月10日(金) エポック立命21

●参加費 無料
レセプションは10日(金) 18:30～
レセプション参加費は当日お支払い下さい

講演者

M. Arisawa, (有澤真理子)	• Tohoku University
R. Cont,	• École Polytechnique
E. Gobet,	• INP Grenoble-ENSIMAG
T. Fujita, (藤田岳彦)	• Hitotsubashi University
K. Hara, (原 啓介)	• Ritsumeikan University
K. Hori, (堀 敬一)	• Ritsumeikan University
J. Imai, (今井潤一)	• Tohoku University
P. Imkeller,	• Humboldt Universität
H. Kunita, (國田 寛)	• Nanzan University
T. Lyons,	• University of Oxford
H. Nagai, (長井英生)	• Osaka University
V. T. Nguyen,	• Hanoi Institute of mathematics
S. Ninomiya, (二宮祥一)	• Tokyo Institute of Technology
K. Nishioka, (西岡國雄)	• Chuo University
H. Pham,	• Université Paris-7
M. Pontier,	• Université Paul-Sabatier
W. Runggaldier,	• Università Padova
M. Schweizer,	• ETH Zürich
A. Shiryaev,	• Steklov Institute
J. A. Yan,	• Academia Sinica
X. Y. Zhou,	• Hong-Kong University

$$f(X_t) = f(X_0) + \int_0^t f'(X_s) dM_s + \int_0^t f''(X_s) dA_s + \frac{1}{2} \int_0^t f''(X_s) d\langle M \rangle_s, \quad 0 \leq t < \infty.$$

参加申込・問合せ

立命館大学 BKCリエゾンオフィス 五十川・藤澤
Email; spa@st.ritsumeai.ac.jp
URL; http://www.finance.ritsumeai.ac.jp/2006/
Tel; 077-561-5025 Fax; 077-561-2811

シンポジウム組織委員会

委員長 小川 重義 (立命館大学・ファイナンス研究センター長)
委員 赤堀 次郎 (立命館大学) 井澤 裕司 (立命館大学)
秦 劫 (立命館大学) 原 啓介 (立命館大学)
平田 純一 (立命館大学) 堀 敬一 (立命館大学)
渡辺 信三 (立命館大学) 山田 俊雄 (立命館大学)
國田 寛 (南山大学) 楠岡 成雄 (東京大学)
長井 英生 (大阪大学)
H. Pham (Université Paris-7)
M. Pontier (Université Paul-Sabatier)

