

第一回 「粘性解、最適制御、数理ファイナンス」 ワークショップ

日時 2025年3月16日13:30～17日17:15

場所 早稲田大学 西早稲田キャンパス（副都心線 西早稲田駅 真上）
55号館N棟1階第二会議室

代表 小池茂昭（早稲田大学）
skoike @ waseda.jp
豊泉洋（早稲田大学）
toyoizumi @ waseda.jp

3月16日（日）

- 13:30～14:15 豊泉 洋（早稲田大学：Toyoizumi Hiroshi）
「ポアソン過程によって駆動される最適制御問題」
- 14:30～15:15 牧田 慎平（北海道大学：Makida Shimpei）
「Stability of metric viscosity solutions under
Hausdorff convergence」
- 15:30～16:15 細矢 祐誉（中央大学：Hosoya Yuhki）
「The Hamilton-Jacobi-Bellman Equation in Economic
Dynamics with a Non-Smooth Fiscal Policy」
- 16:30～17:15 Zhanpeisov Erbol（沖縄科学技術大学院大学
：ザンペイソフ エルボル）
「Liouville-type theorems for fully nonlinear elliptic
and parabolic equations with boundary degeneracy」

3月17日（月）

- 10:00~10:45 辻村 元男（同志社大学：Tsujimura Motoh）
「Assessing a wind power generation capacity
with Long-Term Decarbonization Power
Auction under risk」
- 11:00~11:45 佐藤 卓弥（東京大学：Sato Takuya）
「異方性を持つ平均曲率流方程式の自由境界問題」
- 13:30~14:15 後藤 允（東京理科大学：Goto Makoto）
「Pandemic Options under a Stochastic SIR Model」
- 14:30~15:15 渡辺 樹（大分大学：Watanabe Itsuki）
「Optimal control of Markov jump process
- viscosity solution approach」
- 15:30~16:15 吉岡 秀和（北陸先端科学技術大学院大学
：Yoshioka Hidekazu）
「境界への到達可能性が時間的に変化する系に
対応する退化楕円型方程式の数値計算」
- 16:30~17:15 小杉 卓裕（福岡工業大学：Kosugi Takahiro）
「Existence of solutions of a price formation
via mean-field games」

懇親会（予定）

注意：3月16日は日曜日のため、大学入校には学外者の方は、西門（高田馬場駅方面）からの入校となります。また、西門守衛室に参加者リストを提出する必要がありますので、3月14日までに代表者に3月16日の参加をお伝えください。3月17日は、自由に出入りできます。