

2025 年度 傾斜的研究費（全学分）
研究センター対象国際研究集会等開催支援 研究報告書

※本学 HP での公表を前提に記入してください。

【研究費区分】： 国際研究集会等開催支援

【所属】： 経済経営学部

【氏名】： 内山 朋規

【氏名フリガナ】： ウチャマ トモノリ

【職】： 教授

【国際研究集会等の概要（イベント概要が分かる資料を添付）】

*複数開催した場合は、そのすべてについて記載すること。

- ・ 名称： TMU Workshop on Finance 2025
- ・ 日時： 2025 年 10 月 28 日（火）～ 29 日（水）
- ・ 場所： 東京都立大学丸の内サテライトキャンパス（講演者対面），オンライン（一般参加者）
- ・ URL： <https://sites.google.com/view/tmuworkshoponfinance2025/>

【招聘した外国人研究者（イベント概要が分かる資料を添付）】

Lei Gao – George Mason University（アメリカ）

Jeonggyu Huh – Sungkyunkwan University（韓国）

Donghan Kim – KAIST（韓国）

Kyunghyun Park – Nanyang Technological University（シンガポール）

Cindy Shin Huei Wang – Peking University（中国）

【報告（実施後の成果）】

（国際研究集会等の参加者数）

*複数開催した場合、イベントごとの参加者数を記入すること。

参加者総数 65 名（内、海外研究者数 13 名）

（成果の概要）

TMU Workshop on Finance 2025 は、2025 年 10 月 28 日から 29 日にかけて東京都立大学丸の内サテライトキャンパスで開催された。本ワークショップは、数理ファイナンスおよび金融工学に関する最新の研究成果の共有と、国際的な研究動向の把握、ならびに研究者間の活発な議論と意見交換を目的として実施された。本年度は、海外からは 5 名、国内からは 8 名の研究者を招聘し、連続時間ポートフォリオ最適化、強化学習と最適停止問題、レヴィ過程に基づく解析的手法、ラフボラティリティモデル、統計的検定手法、企業財務データ分析など、多岐にわたるテーマについて研究発表が行われた。また、金融市場における情報開示、投資家行動、トレーディング戦略、デリバティブ価格付けなど、理論と実証の双方にまたがる幅広い研究領域が扱われた。各セッションにおいては、講演内容に関する活発な質疑

応答および議論が行われ、異なる研究分野・アプローチ間の交流が促進された。これにより、数理ファイナンスおよび金融工学の最先端の研究動向に対する理解が深まるとともに、新たな研究課題や共同研究の可能性が見出される有意義な機会となった。本ワークショップは、参加者にとって極めて有益な場となり、今後の研究の発展に資する重要な成果を挙げたといえる。