「システム情報数理学特選」

(情報科学研究科・集中講義)

下記のとおり授業日程等が決まりましたので、お知らせします。

講師：長井 英生 氏
(大阪大学大学院 基礎工学研究科 教授)

講義題目：システム情報数理学特選

単位数：2単位

授業内容はシラバスを参照してください。

<http://syllabus.is.tohoku.ac.jp/syllabus/>

(概要)

数理ファイナンスの基本的な考え方を解説する。効用関数、リスク回避度、平均分散解析等について解説した後に、裁定機会、条件付き請求権、リスク中立確率、等の基本的概念と、完備な市場におけるデリバティブの価格付けの理論を有限確率空間の枠組みで解説する。時間があれば金利モデルについても触れる。

日程：10月24日(月)～28日(金)

	8:50～ 10:20	10:30～ 12:00	13:00～ 14:30	14:40～ 16:10	16:20～ 17:50
10月24日 (月)			○	○	○
10月25日 (火)			○	○	○
10月26日 (水)			○	○	○
10月27日 (木)			○	○	○
10月28日 (金)			○	○	○

教室は情報科学研究科棟 大講義室を予定しています。

履修登録について：第2学期履修登録期間(10/3(月)～10/14(金))に教務情報システムより履修登録して下さい。

平成23年9月5日
情報科学研究科教務係