

集中講義のお知らせ

講師

芝浦工業大学システム理工学部
准教授 中津智則 先生

タイトル

「2項モデルによる金融商品の
価格付け」

*** 講義内容 ***

本集中講義では、2項モデルと呼ばれる確率モデルを用いた、金融商品の価格付けについて解説する。本講義で扱う2項モデルは非常に簡単なモデルであるが、価格付けの考え方は、より複雑なモデルになっても同様である。

科目名 (科目番号) 対象年次

3年次：特別講義IX（数理307）
4年次：情報数理学特論IV（数理476）
院 生：情報数理学特別講義V

期 間

令和4年11月14日(月)～11月18日(金)

担当教員 …… 林 正史

登録方法 …… 数理科学科事務室の名簿へ直接記入して下さい。

登録期間 …… 令和4年10月7日(金)～令和4年11月7日(月)