

電気通信大学 平成19年度シラバス

授業科目名	応用確率解析		
英文授業科目名	Applied Analytics of Probability		
開講年度	2007年度	開講年次	3年次
開講学期	後学期	開講コース・課程	昼間コース
授業の方法		単位数	2
科目区分	専門科目-学科専門科目-選択科目		
開講学科・専攻	システム工学科		
担当教官名	宮崎 浩一		
居室	西5 - 503		

公開E-Mail	授業関連Webページ

【主題および達成目標】
<p>オプションの評価に利用される確率過程論・確率解析の基本を理解する。</p> <p>(1)二項モデル（離散時間）を説明できる。</p> <p>(2)マルチンゲール概念を説明できる。</p> <p>(3)確率積分の考え方を理解し、伊藤の公式を利用することができる。</p> <p>(4)上記の(1)～(3)を踏まえたうえで、オプション評価式を説明できる。</p>

【前もって履修しておくべき科目】
特に無し

【前もって履修しておくことが望ましい科目】
確率統計工学第一、第二とオペレーションズリサーチA、B

【教科書等】
(教科書) 宮崎浩一著：証券分析への招待、サイエンティスト社

【授業内容とその進め方】
<p>主題および達成目標に応じた講義を行う。</p> <p>各回の講義を始める前に前回の内容に関する小テストを行い、その都度内容の理解度を確認しながら講義を進める。</p>

電気通信大学 平成19年度シラバス

【成績評価方法及び評価基準(最低達成基準を含む)】

講義に関する試験が60点を超えること。追試も行う。
追試は、試験を受けたが60点に満たない学生が、
「可」を必要とする場合に再度チャンスを与えるものである。

【オフィスアワー：授業相談】

金曜日 16:00 - 18:00

【学生へのメッセージ】

確率関連の数学の基礎を十分に理解して、それがどのようにファイナンスに応用されるかに関して学びましょう。

【その他】