

電気通信大学 平成20年度シラバス

授業科目名	金融工学特論		
英文授業科目名	Topics in Financial Engineering		
開講年度	2008年度	開講年次	
開講学期	前学期	開講コース・課程	博士後期課程
授業の方法	講義	単位数	2
科目区分	電気通信学研究科-システム工学専攻-専門科目		
開講学科・専攻	システム工学専攻		
担当教官名	藤田 岳彦		
居室	非常勤講師		

公開E-Mail	授業関連Webページ
fujita@math.hit-u.ac.jp	

【主題および達成目標】
まず、確率の知識を復習し、それをデリバティブ価格理論に応用する。 ファイナンスとくにデリバティブやその価格理論に関する知識、知見を得ることも目標の一つである。

【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】
特に、無し。

【教科書等】
教科書：ランダムウォークと確率解析、藤田岳彦著、日本評論社 2008年4月刊行予定 参考書：道具としての金融工学、藤田岳彦著、日本実業出版

【授業内容とその進め方】
第1回－第4回 基本的な確率論復習とランダムウォークの定義、基本的性質 第5回－第8回 条件付き期待値とマルチンゲール、離散伊藤公式、離散確率解析 第9回－第12回 デリバティブ価格理論入門 第13回以降 デリバティブ価格理論のやや発展的な話題

電気通信大学 平成20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)】

講義の出席と講義以外に1-2回のレポートを課す。

【オフィスアワー：授業相談】

特に設けない。質問等は電子メールで受け付ける。

【学生へのメッセージ】

確率解析を金融工学を題材に学びましょう。

【その他】
