

電気通信大学 平成18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	2006年度	開講年次	3年次
開講学期	6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
miyazaki@se.uec.ac.jp	

【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)出生死滅モデル（連続時間）を説明できる。</p> <p>(3)マルチンゲールの概念を説明できる。</p> <p>(4)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>(5)上記の(1)～(4)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】
<p>(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</p> <p>(参考書) 森村英典、木島正明、ファイナンスのための確率過程、日科技連</p>

電気通信大学 平成18年度シラバス

【授業内容とその進め方】

- 第一回～第八回 : 主題および達成目標に応じた講義を行う
第九回 : 講義に関する試験
第十回～第十二回 : 講義内容のファイナンスへの応用をプレゼンテーションする
第十三回以降 : 追試及び(予備)

【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(70点)
プレゼンテーションの理解とコメントに関する試験(30点)
以上の合計点が60点を超えること。
追試は、上記2つの試験を受けたが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】