

I. 研究分野

数理ファイナンス, 確率数値解析

II. 研究分野 (英語表記)

Financial mathematics, Stochastic numerical analysis

III. 修士課程学生の履修要件

解析学や数理ファイナンスの基礎を理解していること。

IV. 選考期間および方法

成績・志望動機・面接で数学とファイナンスの理解度を判断し選考する。履修登録期間にメールでアポイントメントを取ること。

V. 指導方針

大学院レベルの数理ファイナンスを基礎から学ぶ (M1)。修士論文では実務の数理的問題や分野の先端テーマを扱えるように指導する (M2)。

VI. 博士後期課程学生の履修要件

数理・計量ファイナンスや関数解析、数値解析に関する科目を履修し、優秀な成績を修めていること。修士論文の内容も考慮する。

VII. 共同開講者に関するメモ

VIII. 詳細リンク先 URL