

齋藤 大河 SAITO Taiga 木曜 4 時限 対面授業

I. 研究分野

数量ファイナンス、ファイナンス経済、応用確率制御

II. 研究分野（英語表記）

Quantitative finance, Applied stochastic control

III. 修士課程学生の履修要件

測度論的確率論の知識を持ち、ファイナンスに関心を持っていること。

IV. 選考期間および方法

成績・志望動機・面接による。履修登録期間にメールでアポイントメントをとること。

V. 指導方針

大学院レベルのファイナンス経済および確率制御の教科書を輪読する（M1）。修士論文では実務の諸問題にそれまでに習得した知識を用いて取り組めるよう指導する（M2）。

VI. 博士後期課程学生の履修要件

数理・計量ファイナンス関連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