

山田 俊皓 YAMADA Toshihiro 木曜 5時限

I. 主な担当科目

計量ファイナンス特論 A・C (2021 年度はサバティカル取得のため開講しない)

II. 研究分野

確率解析、ファイナンス数学

III. 研究分野 (英語表記)

Financial Mathematics, Stochastic calculus

IV. 修士課程学生のゼミ履修要件

2021 年度はサバティカル取得のため基本的には受け入れない。

ただし、前年度に履修していた場合 (前年度 M1 など) や前年度に相談していた場合 (5 年一貫生など) に限り受け入れる。

V. ゼミ選考期間

サバティカル取得のため選考期間はない。

VI. 指導方針

金融工学、数理ファイナンス、確率解析等のテキストを基礎から学ぶ (M1)。修士論文では、実務の数理的問題や分野の先端の話題を扱えるように指導する (M2)。

VII. 博士後期課程への進学要件 (コア科目)

特に指定はない。

VIII. 博士後期課程への進学・編入学要件 (進学資格試験・編入学試験)

研究科の進学・編入学要件を満たすこと。

IX. 博士後期課程への進学・編入学要件 (その他)

計量ファイナンス特論 A・C などを優秀な成績で単位取得し、かつ関数解析・確率解析の基礎を正しく理解していること。修士論文で取り組んでいるテーマ・内容も考慮する。

X. 共同開講者に関するメモ

XI. 詳細リンク先 URL