

田口 大 講師

(岡山大学 准教授)

談話会

5月16日(月) 16:00~

「確率微分方程式の数値解析」

確率解析・確率微分方程式の理論は、伊藤清によって確立され、数学の中に留まらず、数理ファイナンス・物理学・生物学など様々な分野で重要な役割を担う理論である。例えば、数理ファイナンスの研究は、理論・実務の両側面から盛んに研究されており、特に金融派生商品の価格付けは確率微分方程式を用いで行われており、その価格を正確に数値計算することが求められている。しかしながら、一般には確率微分方程式は具体的に解を求めることが難しいため、「離散化」することで近似計算を行う必要がある。本講演では、確率微分方程式の数値解析に関する近年の発展と今後の課題について講演する。

講義
期間
・
題目
・
内容

5月17日(火)~5月20日(金)

各日 15:00~18:00

確率微分方程式の数値解析

確率解析・確率微分方程式の理論は数理ファイナンス・物理学・生物学など様々な分野で重要な役割を担う理論である。この講義では確率解析と確率微分方程式の数値解析の基礎を解説する。

備考

・ 談話会・講義とも対面授業(場所：川井ホール)とリアルタイム配信を実施します。
・ 講義の連絡、資料掲載は Google Classroom を用います。クラスコード / Zoom などの詳細は、数学科・数学専攻のオンライン授業ポータルサイトを確認して下さい。