

冬学期集中講義新規開講のお知らせ

科目名:「応用数理(Computational Finance)」
担当:石村直之先生, Daniel Sevcovic先生
期間:集中講義開講期間(2/8~2/12)、詳細は
決まり次第発表します。

受講を希望する方は下記の要領に従いメールで履修を
申請してください。

- 1.件名欄に「応用数理履修」と記入してください。
- 2.本文に ①学籍番号 ②氏名を記入してください。

メールを受理した場合、連絡事項を返信します。

4営業日以内に返信がない場合はメールが届いていない可能性がありますので、**必ず**経済学研究科事務室に問い合わせてください。

期間:10/20(水)~11/5(金)(期間厳守)

宛先:ec-kyomu@econ.hit-u.ac.jp (経済学研究科事務室)

科目名 Course Name	応用数理(Computational Finance)	教員名 Instructor	石村 直之, Daniel Sevcovic						
学期 Semester	冬期 (W)	曜日 Day	特別講 義	時限 Period	集中講 義	単位 Credit	2	科目区分 Course Category	経済学研究科

[授業概要 (Course Overview)] 最終更新日:2010-10-15

Analytical and numerical method of financial-derivative pricing are provided.

[学部・学年の指定 (Who Should Attend)] 最終更新日:2010-10-15

※履修ルール上の指定内容については必ずルールブックおよびガイドブックの該当箇所を確認して下さい。

Graduate students

[授業の目的・到達目標と方法 (Goals & Methodology)] 最終更新日:2010-10-15

Graduate students who will attend this lecture are required to learn about the basic properties and method of financial-derivative pricing both in analytical and numerical ways.

[授業の内容・計画 (Topics / Schedule)] 最終更新日:2010-10-15

stochastic character of assets, financial derivatives
stochastic differential calculus, Ito calculus
pricing European type options
transaction cost model, some exotic options
modeling of stochastic interest rates, interest rate derivatives
American type options and the free boundary problem
Numerical methods for pricing American type options

[テキスト・参考文献 (Textbooks / References)] 最終更新日:2010-10-15

Textbooks and references are referred in the lecture.

[質問等の連絡先・オフィスアワー (Contact Information / Office Hours)] 最終更新日:2010-10-15

Please use the after-time of each lecture.

[他の授業科目との関連・教育課程の中での位置付け (Relation with other Courses)] 最終更新日:2010-10-16

Basic knowledge of financial economics and mathematics are necessary.

[成績評価の方法 (Requirements & Grading Allocation)] 最終更新日:2010-10-15

Attendance to the lecture will be highly estimated. Short report may be imposed.

[成績評価基準の内容 (Grading Criteria)] 最終更新日:2010-10-15

Attendance is at least indispensable.

[受講生に対するメッセージ (Message to Students)]

[その他 (Additional Information)] 最終更新日:2010-10-15

Lectures are mostly given by Professor Daniel Sevcovic in English.