

第07回

- 講演者：赤堀 次郎 氏（立命館大学）
 - 題目：離散確率解析について(On Discrete Stochastic Calculus)
 - 日時：平成26年6月11日（水）17:30 – 18:30

ブラウン運動(やレビ過程)に基づいた微積分学である 確率解析の離散版の類似物である離散確率解析について その目的と応用，特に数理ファイナンスへの応用について紹介します。

I will talk on “discrete stochastic calculus”, its target and applications, especially to mathematical finance. It is a discrete analogue of the stochastic calculus based on Brownian motions (or Levy processes).



.lg-outer.lg-pull-caption-up.lg-thumb-open .lg-sub-html {bottom:80px;}

11 images

From:

<https://wiki.ma.noda.tus.ac.jp/> - (旧)理工学部 数学科

Permanent link:

<https://wiki.ma.noda.tus.ac.jp/seminar/2014/007>

Last update: **2017/11/16 18:23**

