

2009年10月27日

各位

南山大学数理情報研究センター  
センター長 尾崎 俊治

### 研究会開催のお知らせ

南山大学数理情報研究センターでは、北海道大学木村俊一教授が研究代表者（本学澤木勝茂教授が研究分担者）である平成21年度科学研究費補助金プロジェクト「OR指向ファイナンスにおける意思決定支援モデルの開発」および南山学会との共催で以下の研究会を開催いたします。ご多忙中とは存じますが、ぜひご参加いただきますよう、ご案内申し上げます。

### 記

日時：2009年10月30日（金）午後3時30分～午後5時30分

場所：南山大学名古屋キャンパス J55 教室

講師：國田 寛 氏（九州大学名誉教授、南山大学元教授）

テーマ：Ito's stochastic calculus. Its surprising power for an application  
into mathematical finance

（伊藤の確率解析と数理ファイナンスへの応用）

### 概要：

第一回ガウス賞を受賞した伊藤の初期の仕事を確率積分、確率微積分方程式およびその応用について展望する。さらにマーチンゲール理論との結合によってどのように伊藤の定理が進展してきたかを論じる。特に、数理ファイナンスにおける伊藤の確率解析の役割および応用の広がりについて詳細に論考する。

以上

### 【本件問い合わせ先】

南山大学 情報理工学部事務室

〒489-0863 瀬戸市せいでい町 27 番地

Phone : 0561-89-2081

E-mail : suuri-common@nanzan-u.ac.jp