

KFR セミナー

確率過程の基礎と応用の技術講座

(7/11 更新)
開始時刻変更

株価や為替などの数理ファイナンス分野では、確率過程の教育は大学レベルでも行われており、また、確率過程を基に作られた金融商品も存在しています。一方、我々船舶海洋工学分野でも、確率過程の知識を用いた研究がこれまでも行われてきました。しかし、工学分野の大学教育で、確率過程の授業があまり存在せず、自学のハードルもやや高いように見えてしまいがちです。特に、伊藤の確率微分方程式である

$$dX(t) = \mu(X(t))dt + \sigma(X(t))dW(t)$$

というような、あまり見かけない微分記号の使われ方をする式を見ると、つい何だかよく分からない、となってしまうがちかもしれません。

今回の KFR 例会では、確率過程を専門とする応用数学者の Dr. Leo Dostal (Hamburg 工科大学) に、確率過程の基礎と応用について、英語での講演を頂きます。また、実応用についても、KFR 事務局の大阪大学の丸山・牧より日本語で若干の紹介をします。これは基礎技術講座であり、講演よりも講義に近い形式で行います。ご関心をお持ちの多数の方々のご参加をお待ちしております。

KFR 会長 鈴木 博善

— 記 —

第352回 KFR セミナー

- 日時：2022年8月3日(水) 1300～1700
- 場所：Webexでの実施です。(詳細URLは後程、メールでお伝えします。)
- 参加費：無料、要事前登録

・ 確率過程の基礎と応用 (Dr. Leo Dostal : Hamburg工科大学)

1300～1630 (途中、休憩を含む)

確率過程について、全くのゼロから解説をします。ウィーナー過程の性質に始まり、FPK方程式の導出に至るまで、数学的な背景を一挙に説明をします。応用例の一つとして、確率的最適制御についても解説します。(使用言語：英語)

・ 復原性・操縦性分野などにおける確率過程の応用研究の紹介

(丸山 湧生・牧 敦生：大阪大学)

1630～1700

復原性・操縦性分野でこれまで講演者が行ってきた研究を紹介し、確率過程の知識が船舶海洋分野における研究にリンクをしていることを説明します。(使用言語：英語)

ご参加のお申し込みは、8月2日(火)までに下記URL (QRコード) からお願いいたします。

<https://forms.gle/hA381BiyBh5gsDzB9>



問合せ先：日本船舶海洋工学会 関西支部 事務局・牧 敦生
TEL：06-6879-7593 FAX：06-6879-7594
E-mail：k.office@jasnaoe.or.jp

以上