

## 新井拓児研究会（数理ファイナンス・確率論） 第二回入ゼミ説明会 2013/10/5

### 1, ゼミ内容紹介

ファイナンスは、現在から将来にかかわる「時間」を通じた資源の配分を検討する学問であり、大きく分けて「企業金融論」と「資産価格論」の2つがありますが、本研究会では後者に、とりわけデリバティブの一種であるオプションの価格付けに取り組むことを目的としています。

ファイナンスでは「不確実性」を含むモデルを扱うことが多いため、その学習にはどうしても確率論が必要になりますから、こちらも合わせて学習します。

現在、ファイナンス的な思考とその知識はますます重視されてきており、金融や証券関係、財務はもちろんのこと、その他どのような進路になろうとファイナンスは必須になりつつあります。実際、ファイナンスは現在の世界でのビジネスにおける共通言語のような役割を果たしており、仕事をするときでもファイナンスに則った話の進め方をしないと理解してもらえないことが往々にしてありえます。ゆえに、学生時代にファイナンスを学んでおくと将来確実に役に立ちます。

### 2, ゼミ試について

定員：5名

試験内容：微分積分・線形代数

現在の形になってからは毎年A日程で募集打ち切りになっている（例えばAで3人合格などの場合でもB日程の追加募集はしないものと思われま）ため、志望する方はA日程での受験をおねがいします。

### 3, ゼミ員から見た先生

新井先生は日吉で授業を持っておられないためご存知のかたはあまりいないと思いますが、優しく、ゼミ中にわからないところがあると丁寧に教えて下さいます。また、ゼミ員の相談にもよくのってくださる一方で、海外にいた時の話など面白い雑談等もして下さいます。

### 4, 新入生（8期生）へのPR

新井研究会は少人数なためアットホームかつ、やりたいことの希望があればやれ、全員が積極的にゼミに取り組んでいます。また、当ゼミで取り組んでいるオプションの価格付け理論はいわゆる数理ファイナンスと呼ばれる分野の中心的なものであり、将来役立つ可能性が大いにあります。ファイナンスや数学に興味がある方のみならず、数学を少し苦手だと感じる方でもやる気のある方もお待ちしております。

### 5, HP

<http://seminar.econ.keio.ac.jp/arai/>

に過去問・入ゼミ情報などを載せてあります。

### 6, 質問

k0t96-araiseminar あつと yahoo.co.jp まで。