

# 森本 裕介 氏

## (三菱UFJ銀行)

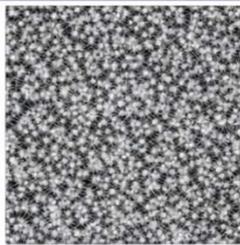


### 金融工学とデータサイエンスにおける 確率解析的手法

数学の一分野である確率解析は、幅広い分野で応用されている。特に金融機関では、マーケット変動を確率微分方程式によってモデル化し、そこから算出されるデリバティブ価格を用いて実際の取引が行われている。そのため、マーケットをより正確に表現するためのモデル高度化と価格計算の精緻化及び高速化が常に求められている。こうした要求に応えるため、金融工学ではさまざまな確率解析的手法が考案されてきた。

さらに近年注目を集めている生成AIの拡散モデルにおいても確率微分方程式が用いられており、金融工学と類似の手法が活用され、さらなる発展を見せている。

本講演では、こうした手法について説明し、今後の展望について述べたい。



↓参加登録はこちら↓



# 3月6日 (金) 17:00-18:20

武蔵野大学有明キャンパス, 4号館305教室, ハイブリッド開催

参加ご希望の方は、右上のQRコードより参加登録をお願いいたします。

参加費無料 **登録締切: 3/5 (木)**

国際展示場駅 徒歩7分  
東京ビッグサイト駅 徒歩6分



コーディネーター: 時弘 哲治 (武蔵野大学工学部数理工学科 教授)

問い合わせ先: 武蔵野大学数理工学センター

[https://www.musashino-u.ac.jp/research/laboratory/mathematical\\_engineering/](https://www.musashino-u.ac.jp/research/laboratory/mathematical_engineering/)

世界の幸せをカタチにする。  
Leading Facts to a better world

