

平成 21 年 1 月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研修会担当理事 金村慶二・河野年洋

JARIP 平成 20 年度第 4 回研修会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお喜び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の平成 20 年度第 4 回研修会を下記のとおり開催しますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

1. 研修会の概要（詳細は別紙）

テーマ： 数理ファイナンスにも現れるブラウン運動の不思議

注) 数理ファイナンスの基本から学びたい方を想定し、数理ファイナンスの基礎であるブラウン運動から、各種特徴やエピソードも交えながら講義します（詳しくは別紙の講義概要を参照）。

講師： 森 真（日本大学文理学部教授）

日時：2009 年 2 月 3 日（火） 15：00～18：00

場所：ニッセイ同和損保 東京本社 42 階第 1 会議室（中央区明石町 8-1）

2. 参加申込（E-mail で申し込み願います）

- ・ 申込方法：メール・タイトルは「2月3日 J A R I P 研修会申込」として下さい。
参加者氏名、個人会員・法人会員・学生会員・非会員の区別、組織名、E-mail アドレス、電話番号、及び領収書が必要な場合はその旨を明記
(事前に領収書必要の連絡がなかった方には、領収書を発行しません)。
- ・ 申込先： TO: office@jarip.org (J A R I P 事務局)
CC: toshihiro_kawano@slapc.com (〃 研修会担当 河野 年洋)
- ・ 申込〆切：1月29日（木）

3. 参加費

会員；1,000 円、学生会員；無料、非会員；5,000 円

(法人会員は、3 名までは 1 人当たり 1,000 円、それ以上は 1 人当たり 5,000 円となります)

参加費は、研修会当日、会場受付にてお支払い下さい。

以上

A. 講義概要「数理ファイナンスにも現れるブラウン運動の不思議」

ブラウン運動は1827年にイギリスの植物学者ブラウンが水に浮かぶ花粉の微粒子が不規則な運動をすることを顕微鏡を用いて発見したことに始まると言われています。花粉は生物ですから、ブラウン自身も生命体の運動であると思ったのでしょう。それを有名なアインシュタインによって1905年に水の分子の運動から生じるものであるということがわかりました。

20世紀になってルベーグ積分が構築されました。それを用いて、20世紀後半になって確率論が数学として定式化されるとともに、ブラウン運動も数学の対象となりました。そして、わずかな年月の間に急速な進歩を遂げて、数理ファイナンスなど、経済活動でもかかせないものとなりました。

そうはいうものの、ごく最近になるまで、数学として成立していなかったのには、それなりの理由があり、とても風変わりなものなのです。そうしたことを、ブラック・ショールズ式の導出や、なぜ熱方程式と関わりがあるのかなども含めてお話していきたいと思います。

B. 講師プロフィール

森 真

- ・ 東京大学数学科卒業
- ・ 現在、日本大学文理学部教授
- ・ 専門はエルゴード理論
- ・ 著書に、確率統計入門(講談社、藤田岳彦氏と共著)、ルベーグ積分超入門(共立出版)など

C. 研修会日時：2009年2月3日(木) 15:00～18:00

D. 場所：ニッセイ同和損保 東京本社42階第1会議室

〒104-8556 東京都中央区明石町8-1 聖路加タワー42階

有楽町線新富町または日比谷線築地駅より徒歩8分



以上