

平成 21 年度

# 広島大学理学研究科 数学教室談話会

平成 21 年 11 月 10 日 (火) 午後 1 時  
広島大学理学部 B 棟 7 階 B707 教室

長井 英生 氏 (大阪大学大学院基礎工学研究科)

## Large time asymptotics of the probability minimizing down-side risk

数理ファイナンスに現れる次のような時間大域的問題を考察する。各時刻  $T$  において投資家の持つ資産が与えられた目標成長率を下回る確率を最小化する問題を考える。時刻  $T$  を大きくした時の、この最小値の漸近的挙動を考察する問題を、大偏差確率制御の問題ととらえる。そして、対応する Risk-sensitive control の双対問題とみなすことにより、求めようとする確率の漸近挙動を明示的に表現する。また、その最適ポートフォリオを求める。

同日午後 2 時より小会議室 (B708) において講演者を囲んでのお茶会を開きます。お気軽にご参加ください。

問合せ先:

広島大学理学研究科数学教室談話会係

〒 739-8526 東広島市鏡山 1-3-1

電話: 082-424-7335 (小林)

email: ryo@math.sci.hiroshima-u.ac.jp

最新の教室情報はホームページをご覧ください。

<http://www.math.sci.hiroshima-u.ac.jp/>