

2025 年 10 月 30 日

株式会社 GCI アセット・マネジメント

当社アドバイザーによる書籍出版のお知らせ

拝啓 時下ますますご清栄のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご高配を賜り、厚くお礼申し上げます。

このたび、当社アドバイザーの高橋明彦教授(東京大学大学院経済学研究科)および、GCI グループ研究機関「京都ラボ」上席研究員の山田俊皓教授(一橋大学大学院経済学研究科)が共同で、確率微分方程式の漸近展開(asymptotic expansion)と高次弱近似(high order weak approximation)に関する新たな数学的手法を提唱し、ディープラーニングとの融合による高次元金融モデルへの応用を解説した書籍『Asymptotic Expansion and Weak Approximation』を上梓しましたので、ご案内申し上げます。

本書では、従来の近似手法では困難であった高次元非線形問題に対し、漸近展開に基づく弱近似とニューラルネットワークによる近似を組み合わせる新手法を、具体例を交えて紹介しています。金融工学やリスク管理、資産運用の高度化に資する実務的知見が得られる内容となっております。

当社では今後も、アドバイザー陣の専門的知見を活かし、より高度な運用およびリサーチ活動に努めて参ります。

敬具

記

著書情報

- 1.書籍名: 『Asymptotic Expansion and Weak Approximation』
Applications of Malliavin Calculus and Deep Learning / 2025
- 2.執筆: 高橋明彦教授(東京大学大学院経済学研究科教授)
山田俊皓教授(一橋大学大学院経済学研究科教授)
- 3.URL: <https://link.springer.com/book/10.1007/978-981-96-8280-5>

以上



株式会社 GCI アセット・マネジメント
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 436 号
加入協会: 一般社団法人日本投資顧問業協会
一般社団法人投資信託協会

<本件に関するお問い合わせ>
株式会社 GCI アセット・マネジメント
TEL 03-6665-6950
受付時間: 午前 9 時～午後 5 時 土、日、祝・休日は除きます。