

研究集会・プログラム

科学研究プロジェクト「経済リスクの統計学の新展開：希な事象と再帰的事象」

日程：2016年12月22日(木)

会場：東京大学経済学部小島ホール1階

オーガナイザー：国友直人・大森裕浩

<セッションI：金融市場の統計分析>

Chair: 大屋幸輔

13:00~13:40 「Dynamics of Integration in East Asian Equity Markets」 Tatsuyoshi Okimoto (Australian National University)

13:40~14:20 「Simultaneous multivariate point process models with an application to causality analysis of financial markets」 国友直人・栗栖大輔・天野裕介・粟屋直

<休憩>

<セッションII：経済リスクの統計的基礎>

Chair: 大森裕浩

14:25~15:05 「On Greeks」 楠岡成雄

15:05~15:40 「On rare events」 Tomoyuki Ichiba (University of California, Santa-Barbara)

15:45~16:15 「Discretization of Self-Exciting Peaks Over Threshold Models」 栗栖大輔

<休憩>

<セッションIII：保険リスクと統計学>

Chair: 川崎能典

16:20~17:00 「Dynamic risk measures for stochastic asset processes from ruin theory」 清水泰隆

17:00~17:40 「日本人の寿命 -過去・現在・未来-」 田中周二・長谷川敏彦・伊藤憲祐