

2009 年度 コハツチーム口頭発表

① 招待講演 (国内 0 件、国際 03 件)

発表者: Masaaki Fukasawa (CSFI),
タイトル: Asymptotically Efficient Discrete Hedging
学会名: The 4th Bachelier Colloquium
場所: Metabief, France
日時: 2010/1/24-31

*発表者: Arturo Kohatsu-Higa (Osaka University)
タイトル: Higher order Monte Carlo Schemes for SDE's
学会名: Workshop on Statistics and Mathematical Finance
場所: Lima, Peru
日時: 2010/02/05

*発表者: Arturo Kohatsu-Higa (Osaka University)
タイトル: Recent results on Greek estimation for financial quantities
学会名: ICC Workshop on IT Convergence
場所: Seoul, Korea
日時: 2010/02/18

② 口頭講演 (国内 02 件、国際 02 件)

発表者: Yasutaka Shimizu (Osaka University)
演題: Quadratic type contrast functions for discretely observed non-ergodic diffusion processes
学会名: DYNSTOCH 2009
場所: Berlin, Germany
日時: 2009/10/8

発表者: Masayuki Uchida (Osaka University)
演題: Parametric estimation of the volatility for a stochastic differential equation
学会名: DYNSTOCH 2009
場所: Berlin, Germany
日時: 2009/10/10

発表者: Yasutaka Shimizu (Osaka University)

演題: Estimation of parameters for discretely observed diffusion processes with a variety of rates for information

学会名: Stochastic Analysis and Statistical Inference V

場所: Tokyo (Tokyo Univ.)

日時: 2010/2/23

発表者: Yasutaka Shimizu (Osaka University))

タイトル: Estimation of parameters for discretely observed diffusion processes with a variety of rates for information

学会名: 統計的推測法の発展と応用

場所: Hiroshima (Hiroshima Univ.)

日時: 2010/3/16

③ ポスター発表 (国内 0 件、国際 0 件)