2010年度 コハツチーム口頭発表

① 招待講演　　（国内 1件、国際 7件）

〈国内〉

1. 林正史，飛躍型確率微分方程式に対する漸近展開定理，金融工学・数理計量ファイナンスの諸問題2010，大阪市中央公会堂(中之島)，2010年12月3日-12月4日

〈国際〉

1. Arturo Kohatsu-Higa, A Malliavin Calculus method to study SDE's with irregular drifts. Ajou Conference in honour of Alain Bensoussan, Korea, July 14, 2010.

2. *Arturo Kohatsu-Higa, Approximations for SDE Driven by Lévy Processes. KIER-TMU International Workshop on Financial Engineering 2010,Tokyo-Japan August 2, 2010.

3. Arturo Kohatsu-Higa, Numerical Methods for SDEs driven by Lévy processes. Short course at Sydney University, Sydney- Australia, August 4-12, 2010.

4. Arturo Kohatsu-Higa, A Malliavin Calculus method to study SDE's with irregular drifts. ICM Satellite Conference on Probability and Stochastic Processes, Indian Statistical Institute, Bangalore-India, August 13-17, 2010.

5. Masayuki Uchida, "Statistical estimation of the volatility for a stochastic differential equation", 34th Conference on Stochastic Processes and Their Applications, Senri life science center building, Osaka, 6-10 September 2010.

6. Masayuki Uchida, "Adaptive estimation of an ergodic diffusion process from discrete observations", Korean Statistical Society conference, Kyonggi University, Korea, 4-5 November 2010

7. *Masayuki Uchida, "Adaptive estimation of discretely observed ergodic diffusions", CREST and Sakigake International Symposium, Tokyo Institute of Technology University, Tokyo, 14-18 December 2010

② 口頭講演 （国内 9件、国際 9件）

〈国内〉

1. 清水泰隆, “Brief Introduction to Risk Theory with Future Statistical Issues”, 統計数理研究所共同研究集会「統計サマーセミナー2010」, 伊豆長岡ホテルサンバレー富士見, 静岡, 2010年8月1- 4日

2.大屋幸輔, ″Model-free Implied Volatility: From Surface to Index", Summer Workshop on Economic Theory, 小樽商科大学札幌サテライト（深澤正彰，石田功，Nabil Maghrebi, 生方雅人，山崎和俊との共著）, 2010年8月8日

3. 清水泰隆, “摂動リスクモデルに対する期待割引罰則関数の推定”, 2010年統計関連学会連合大会，早稲田大学，東京, 2011年9月5－8日

4. 清水泰隆, “Gerber-Shiu functions and the statistical inference”, 統計モデルによる現象の解析, 並びにその基礎理論，山形テルサ，山形, 2011年10月21－23日

5. 清水泰隆, “Gerber-Shiu functions and the statistical inference”, 諸分野との協働による数理科学のフロンティア，京都大学数理解析研究所，京都, 2011年11月17－19日

6. Masayuki Uchida, “Adaptive ML-type estimators of ergodic diffusion processes”, 諸分野との協働による数理科学のフロンティア，京都大学数理解析研究所，京都，2011年11月17－19日

7. 林正史,「飛躍型確率微分方程式の漸近展開公式について」, ファイナンスの数理解析とその応用，京都大学数理解析研究所, 2011年11月24日−11月26日

8. Azmi Makhlouf, "BSDE and defaultable claims", Osaka University, Crest seminar, November 26, 2010.

9. 清水泰隆, “Nonparametric estimation of the Gerber-Shiu function”, 金融工学・数理・計量ファイナンスの諸問題2010，大阪市中央公会堂，大阪, 2011年12月3－4日

〈国際〉

1. Masayuki Uchida, “Adaptive estimation of an ergodic diffusion process based on sampled data”, DYNSTOCH Meeting, Bon Pasteur Accueil, Angers, France, 16-19 June 2010

2. Yasutaka Shimizu, “Nonparametric estimation of the Gerber-Shiu function for the risk process perturbed by diffusion”, The 14th International Congress on Insurance : Mathematics and Economics, Toronto, Canada, June 17 - 19, 2010.

3. Masaaki Fukasawa, “Asymptotic analysis for stochastic volatility: Edgeworth expansion”, The Bachelier Finance Society, Toronto, June 26, 2010.

4. Masaaki Fukasawa, “Discretization error in stochastic integration”, The Bernoulli Society, Osaka, September 10, 2010.

5. Azmi Makhlouf, "The tracking error rate of the Delta-Gamma hedging strategy". SPA conference, Osaka Senri Life Science Center, September 6-10, 2010.

6. Yasutaka Shimizu, “Nonparametric estimation of the Gerber-Shiu function for the risk process perturbed by diffusion”, Workshop on “Mathematical Finance and Related Issues”, Kyoto Research Park, Kyoto, Japan, September 12 - 15, 2010.

7. Azmi Makhlouf. "L2-time regularity of BSDE with irregular terminal functions".Workshop on Mathematical Finance and Related Issues, Kyoto Research Park. September 12 - 15, 2010.

8. Azmi Makhlouf. "L2-time regularity of BSDE with irregular terminal functions". New advances in Backward SDEs for financial engineering applications, Tamerza ,Tunisia, October 25 – 28, 2010.

9. Kosuke Oya, "Bayesian estimation of probability of informed trading", 4th CSDA International meeting on Computational and Financial Econometrics, University of London, UK, 2010, December10-12, 2010.