

2011 年度 コハツチーム口頭発表

① 招待講演 (国内 6 件、国際 10 件)

〈国内〉

1. 発表者、タイトル、学会名、場所、月日

A-1.土屋 貴裕、“Probabilistic Representation of a Nonlinear PDE: Analysis and Examples”、CREST and 4th Ritsumeikan-Florence Workshop on Risk, Simulation and Related Topics、立命館アジア太平洋大学、2012 年 3 月 8 日

A-2.土屋 貴裕、“A Simulation of the Radiation Diffusion by a Stochastic Diffusion Model with Geographical Data”、The 43rd ISCIE International Symposium on Stochastic Systems Theory and Its Applications、立命館大学 BKC キャンパス、2011 年 10 月 29 日

A-3.林 正史、“Smoothness of the distribution of the supremum of a diffusion process、Stochastic Analysis and its Applications”、新潟大学 駅南キャンパス ときめいと、2011 年 3 月 17 日

A-4.Hoang-Long Ngo, “On Approximation of Eigenvalues of Spot Cross Volatility Matrix, The 43rd ISCIE International symposium on stochastic systems theory and its applications” Shiga, Japan, 2011 年 10 月 29 日

A-5.田中 秀幸、Higher order weak approximations of stochastic differential equations with and without jumps、Rough Path Analysis and Related Topics、名古屋大学、2012 年 1 月 26 日

B-1.藤井 孝之、“拡散過程の離散観測に基づく AIC 型情報量規準”、2011 年度 中之島ワークショップ 金融工学・数理計量ファイナンスの諸問題、大阪大学中之島センター、2011 年 12 月 3 日

〈国際〉

A-1.Arturo Kohatsu-Higa, “Greeks and Simulation in models with jumps.” Quantitative and Statistical Finance. University of Paris Diderot. Paris VII. March 1, 2012.

A-2.Arturo Kohatsu-Higa, "Approximations for SDEs driven by Levy processes" Workshop Rough Paths and Numerical Integration Methods Philipps-University, Marburg, 21.-23.09.2011

A-3.Arturo Kohatsu-Higa, “Approximation methods for stochastic differential equations driven by Levy processes.” Seventh Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications. Ascona, Switzerland, May 23 - 27, 2011

A-4.Arturo Kohatsu-Higa, “Estimates for the error of some simulation schemes for sde's driven by Levy processes.” 35th Conference on Stochastic Processes and their

Applications ,Oaxaca, Mexico, 2011 年 6 月 19 日-6 月 24 日

A-5.林 正史、“Smoothness of the distribution of the supremum of a diffusion process”、
International conference in mathematics and applications、Ho Chi Minh, Vietnam
2011 年 12 月 21 日

B-1.Masayuki Uchida, Adaptive Bayes type estimation of ergodic diffusion processes
based on sampled data, DYNSTOCH Meeting 2011 at German-American Institute
(DAI) in Heidelberg, June 18, 2011

B-2.Masayuki Uchida , Adaptive estimation for misspecified diffusion processes ,
Statistical Analysis and Related Topics: Theory, Methodology, and Data Analysis
at University of Tokyo, December 16, 2011

B-3.Masayuki Uchida , Adaptive estimation for ergodic diffusions under incorrect
models, Statistics for Stochastic Processes:Inference, Limit Theorems, Finance and
Data Analysis at Institut Louis Bachelier in the former Paris bourse building,
March 12, 2012

B-4.Kosuke Oya, “Implied moments and the related risk measure”, The Second
International Conference on “High-frequency Data Analysis in Financial Market”,
大阪大学中之島センター, 2011/10/28-30

B-5.Yasutaka Shimizu, “On estimating ruin related quantities under Lévy insurance
risks” , Statistics 2011 Canada, Concordia University, Montreal, Canada, 4, July,
2011

② 口頭講演 (国内 9 件、国際 2 件)

〈国内〉

A-1.結城 郷、Local Smoothness of the Densities of Solutions of SDEs with Singular
Coefficients、確率解析とその周辺、佐賀大学、2011 年 11 月 12 日

A-2.結城 郷、Local Smoothness of the Densities of Solutions of SDEs with Singular
Coefficients、潮来ホテル、2011 年 8 月 3 日

A-3.結城 郷、Local Smoothness of the Densities of Solutions of SDEs with Singular
Coefficients、立命館大学数理ファイナンスセミナー、2011 年 7 月 14 日

A-4.田中 秀幸、多次元ラティスによるオプション価格付けへの新アプローチ、日本応用数
理学会 2011 年度年会、同志社大学、2011 年 9 月 11 日

A-5.中津 智則、Volatility Risk for Options Depending on Extrema、数理ファイナンスとそ
の周辺、東北大学経済学研究科、2012 年 1 月 2 日

B-1.深澤正彰、凸リスク測度と資産価格付けの基本定理、日本数学会、信州大学、9 月 28 日

B-2. 藤井 孝之・西山 陽一、局所時間に基づくストレス解放モデルの統計的推測、2011 年度統計関連学会連合大会、九州大学、2011 年 9 月 5 日

B-3. 藤井 孝之・西山 陽一、ストレス解放過程のノンパラメトリックな統計的推測、日本数学会 2011 年度秋季総合分科会、信州大学、2011 年 9 月 30 日

B-4. 藤井 孝之・内田 雅之、離散観測に基づく拡散過程の統計的モデル選択、日本数学会 2012 年度年会、東京理科大学、2012 年 3 月 28 日

〈国際〉

B-1. Kosuke Oya, “Estimating Probability of Informed Trading”, 5th Japanese-European Bayesian Econometrics and Statistics Meeting, Norges Bank, Oslo, 2011/08/23-24

B-2. Yasutaka Shimizu, Edgeworth type expansion of ruin probability under Lévy risk processes in the small loading asymptotics, The 15th International Congress on Insurance : Mathematics and Economics, University of Trieste, Trieste, Italy, 15 June, 2011

③ ポスター発表 (国内 2 件、国際 0 件)

〈国内〉

1. Arturo Kohatsu-Higa、ジャンプ型高次元確率微分方程式:無限次元解析とシミュレーション方法、第 2 回領域シンポジウム 越境する数学 ~CREST 研究報告会~, アキバプラザ5階・アキバホール、2011 年 9 月 7 日(水)

2. 内田 雅之、確率微分方程式の統計的モデリングと金融データ解析への応用、第 2 回領域シンポジウム 越境する数学 ~CREST 研究報告会~, アキバプラザ5階・アキバホール、2011 年 9 月 7 日(水)

〈国際〉

1. 発表者、タイトル、学会名、場所、月日