

講演

オペレーショナル・リスクと極値理論

一橋大学大学院国際企業戦略研究科 准教授 中川 秀敏

(2015年11月14日 日本アクチュアリー会 CERA 研修)

司会 それでは、講師の先生の講義を始めます。

講師の先生をご紹介します。一橋大学の中川秀敏先生です。略歴を紹介いたしますと、1995年に東京大学理学部数学科を卒業されまして、2000年に東京大学大学院数理科学研究科博士課程を修了されております。博士（数理科学）でございます。

2000年にエムティービーインベストメントテクノロジー研究所の연구원となり、その後2003年に東京工業大学理財工学研究センターの助教授となられております。

2008年より現在の一橋大学大学院国際企業戦略研究科の准教授であります。

専門分野は、金融リスク計量、金融工学、数理ファイナンスなどで、書籍『クレジット・デリバティブ信用リスク商品ハンドブック』の監修や、何回も名前が出てきております『定量的リスク管理』の共同翻訳などをされております。

それから、日本アクチュアリー会との関係では、客員を務めておられます。

それでは、先生、よろしくお願いいたします。

中川 一橋大学の中川と申します。本日は、よろしくお願いいたします。

一橋大学をご存じかと思いますが、国立キャンパスの方ではなくて、今は、千代田キャンパスと呼んでおりますが、神保町駅と竹橋駅の間ぐらいにある学術総合センターというビルの中に夜間のビジネススクールがありまして、そちらで主に金融ファイナンスに関係する数学やリスクマネジメントの講義をしております。

皆さんも今日はたぶん朝からワーキンググループなどをされてお疲れだと思いますが、実は、私も土曜日授業担当で、午前と午後に一コマずつやってまいりましたので、お互い疲労困憊でしょうが、最後まで頑張りたいと思います。

しかも、今日の講義のテーマは、松山先生から依頼されました「オペレーショナル・リスクと極値理論」ですが、今日の大学院の授業でも実はこのテーマを取り上げてまいりましたので、私にとっては一度話している内容をもう1回ここで話すこととなります。ただ大学院の授業とは話の力点も違いますし、時間があれば「大学院でこのようなことをやりました」ということで、今日の資料には記載していないことについても少し触れられればよいかなと思います。