

リスク尺度の最近の発展

東京大学大学院数理科学研究科教授 楠岡 成雄

JARIP第6回大会 2008年9月27日 こまばエミナース

【司会】 本日の特別講演ということで、東京大学大学院数理科学研究科教授の楠岡先生からご講演を賜りたいと存じます。確率論およびその応用がご専門で、数理ファイナンスをはじめとして幅広く研究されております先生はJARIPの会員でもありますので、皆さんはよくご存じだと存じます。先生は1978年に東京大学の大学院の修士課程を修了されまして、同年、東京大学理学部助手となられました。それから1993年より東京大学大学院数理科学研究科教授となられております。本日はお忙しいところですが、「リスク尺度についての最近の発展」という大変興味深い話題を取り上げてお話をさせていただきます。よろしくお願ひいたします。

リスク尺度の最近の発展

楠岡成雄 (東京大学数理科学研究科)

1

【楠岡】 ありがとうございます。楠岡でございます。本日のテーマは「リスク尺度の最近の発展」でございますが、実はあまり難しい話をするなといわれています。最近の発展を本当にしゃべると難しすぎるからやめてくれと言われていた部分もありますので、考え方を大雑把にお伝えしたいと思います。最初、前半40分ぐらいは、ご存じのかたにはもうほとんど当たり前の話だという感じかもしれない内容をお話しさせていただきます。