

講演

定量的リスク管理、極値事象、数学と今回の金融危機 QRM, Extremes, Mathematics and the Financial Crisis

ETH チューリッヒ教授 ポール・エンブレヒツ
Prof. Paul Embrechts, ETH Zurich

(訳： 明治大学 松山直樹)

日本アクチュアリー会 平成 21 年度第 3 回例会

平成 21 年 10 月 22 日(木) ベルサール西新宿

(訳注：本稿は掲題の講演の抄訳ですが、演題は講演案内時点のものから発表者本人により変更されています。また解釈と訳語選択の有り得べき誤りは訳者によるものです。)

QRM, Extremes, Mathematics and the Financial Crisis

Paul Embrechts

Department of Mathematics and
Director of RiskLab, ETH Zurich
Senior SFI Chair
www.math.ethz.ch/~embrechts



Embrechts, P., Resnick, S., Samorodnitsky, G.:
Living on the Edge. *RISK*, January 1998, 96-100.

Chavez-Demoulin, V., Embrechts, P.: **Revisiting the edge,
ten years on**. To appear in *Communications in Statistics -
Theory and Methods* (2008/9)

【エンブレヒツ】 ご紹介ありがとうございます。今日ここでみなさんと定量的リスク管理の話題、極値事象、アクチュアリー数理、金融危機について議論できることは大きな喜びです。

さて、過去数カ月から半年くらいのエコノミスト誌の様々な表紙の中で、私が個人的にとっても気に入っているのは World on the edge というものです。他ならぬそのタイトルが気に入った理由は、1998 年に私が Resnik と Samorodnitsky との共著で書いた論文にあります。

それは Risk 誌に書いた Living on the Edge という論文で、金融や保険の世界に向けて、正規分布を超えたところに重要なものがあることを説明しようとしています。最近、あの論文の 10 周年を祝して Revisiting the Edge という論文を書きまして、他ならぬこの雑誌に登場することになっています。