

(資料 2)

ファイナンス研究センター 2011 年度セミナーリスト

4月7日	Tomonori Nakatsu (RITS)	Calculation of Vega for Look back Option
4月14日	Patrik Anderson (RITS)	Bond portfolios with fixed time to maturity
4月21日	Hideyuki Tanaka (RITS)	L^p -time regularity for BSDEs
4月28日	Yuri Imamura (RITS)	Semi-Static Hedging Based on a Generalized Reflection Principle on a Multi Dimensional Brownian Motion
5月9日	Arturo Kohatsu Higa (RITS)	拡散過程の無限次元解析(Infinite dimension analysis of the diffusion process)
5月12日	Arturo Kohatsu Higa (RITS)	Methods to Deal with Non-smooth Coefficients in Malliavin Calculus
5月19日	後田真幸(損保ジャパン)	アクチュアリーについての紹介
5月26日	天羽 隆史(RITS)	Stochastic Hamiltonian dynamical systems, Joan-Aureu L'azaro-Cam and Juan-Pablo Ortega の論文紹介
6月9日	Ngo Hoang Long (RITS)	On multilevel Monte Carlo method for SDE
6月30日	李 力搏(Li Libo) (U. Sydney)	Random times and Enlargement of filtration.
7月7日	竹内 敦司(大阪市大)	Density for stochastic functional differential equations
7月14日	Go Yuki(RITS)	Local Smoothness of densities for SDEs with non singular coefficients
7月21日	Hidemi Aihara(RITS)	Tau function of KP solitons realized in Wiener space
7月28日	Hidemi Aihara(RITS)	Tau function of KP solitons realized in Wiener space: Part 2, Proofs of Theorems
8月4日	Takahiro Tsuchiya(RITS)	On the stochastic flows out of the SDEs with non-Lipschitzian coefficients driven by $S, \mathbb{Y}, \mathbb{Y}\alpha, \mathbb{Y}, S, S$.
8月8日	安田 和弘(法政大)	フラクショナルブラウン運動を用いた確率解析及びその応用
8月19日	Arturo Kohatsu-Higa(RITS)	Optimal Transport for the Euler scheme.
8月25日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義I
8月26日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義II
9月29日	Kenji Yasutomi(RITS)	About the fundamental Theorem of information
10月6日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義III
10月7日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義IV
10月13日	Tomonori Nakatsu(RITS)	Introduction to the paper "Monte Carlo methods on American option sensitivities estimation" (by Nan Chen & Yauchu Liu)
10月20日	Maxime Gazeau (Ecole Polytechnique)	Study of light propagation in optical fiber with randomly varying birefringence
10月27日	Speakers of SSS(RITS)	Rehearsals of SSS
11月10日	Masatake Hirao (Nagoya)	Classical cubature formulas and cubature formulas on Wiener space.
11月17日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義V
11月18日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義VI
11月24日	Andrea Macrina and Parbhoo Priyanka (King's College)	Interest Rate Models with Stochastic Mixtures
12月1日	Eulalia Nualart (Paris)	Hitting probabilities and capacity for SPDEs
12月8日	Bompis Romain (Ecole Polytechnique)	Stochastic expansion in models combining local volatility and stochastic volatility and application to the European options pricing
12月15日	François Delarue (Paris)	Carbon emissions market and singular backward SDEs
12月22日	François Delarue (Paris)	Carbon emissions market and singular backward SDEs (Part2).
12月23日	François Delarue (Paris)	Carbon emissions market and singular backward SDEs (Part3)
12月25日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義VII
12月26日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義VIII
1月13日	Samy Tindel (Nancy)	Lecture 1: Introduction to rough paths.
1月19日	Samy Tindel (Nancy)	Lecture 2: Young integration and preliminary results.
1月20日	Samy Tindel (Nancy)	Lecture 3: Algebraic integration formalism.
1月26日	Toshiki Okumura(RITS)	On a construction of strong solutions for stochastic differential equations with non-Lipschitz coefficients ; a priori estimates approach
2月3日	河備浩司(岡山大)	Rough Path 連続講義IX
2月16日	楠岡誠一郎(京都大)	TBA
2月16日	竹内敦司(大阪市大)	TBA
2月23日	Azmi Makhoulouf(RITS)	TBA
2月23日	田中秀幸(RITS)	TBA
2月29日	Luca Taschini (LSE)	The economics of pollution control I
3月5日	Luca Taschini (LSE)	The economics of pollution control II