

2005年11月2日

会 員 各 位

日 本 フ ァ イ ナ ン ス 学 会
「研究観望会」幹事 竹原 均

第 11 回 研究観望会開催のお知らせ

拝啓 時下ますますご健勝のこととお慶び申し上げます。

さて、日本ファイナンス学会第11回研究観望会を下記の要領により開催することといたしました。今回は、金融実務で近年注目されている「コピュラ copula」をテーマに、報告者吉羽氏がその具体的な活用方法を解説します。コピュラは、周辺分布間の依存構造を扱う1つのツールとして、多変量分布を周辺分布と分布間に分離して表現した関数。しかし金融実務での具体的な活用を解説した文献はほとんどありません。本報告では実例をとりあげながら活用方法を具体的に解説します。たいへん興味深いものですので、ふるってご参加たまわりますようお願い申し上げます。ご出欠につき、同封の申込書(葉書/Fax)またはEメールにて12月6日(火)までにご返事いただければ幸いです。なお、参加者多数の場合には、先着順とさせていただきます。

とりいそぎ、ご案内する次第です。

敬 具

記

テーマ：「コピュラの金融実務での具体的な活用方法の解説」

報告者：吉羽要直 氏(日本銀行金融研究所)

日 時：2005年12月14日(水)午後6時30分より

会 場：学術総合センター2F中会議室(下図参照)

東京都千代田区一ツ橋2-1-2(〒101-8430) Tel: 03(4212)6000

地下鉄「神保町」A8歩3分、地下鉄「竹橋」歩4分



研究観望会のお問合せ先：

幹事 竹原 均(筑波大学社工系助教授)

Tel: 0298(53)6206

メール:takehara@shako.sk.tsukuba.ac.jp

申込先：日本ファイナンス学会事務局
(阿部・小林(奈))

東京都新宿区南元町19(〒160-8519)

Tel:03(3354)2377 Fax:03(3359)7947

E-mail:honbu@nfa.gr.jp

以上