

## 尾張 圭太 (おわり けいた)

2009 年度 COE フェロー

連絡先 keita.owari[at]gmail.com

専攻分野: 数理ファイナンス, 確率論

研究テーマ: モデルの不確実性下における条件付請求権のヘッジと評価

博士学位請求論文題目 (予定):

Hedging and Valuation of Contingent Claims under Model Uncertainty via Robust Utility Maximization

### 学歴

2004 年 3 月 埼玉大学経済学部経済学科卒業

2004 年 4 月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程入学

2006 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程修了 修士 (経済学)

2006 年 4 月 一橋大学大学院経済学研究科博士後期課程入学

2010 年 1 月現在 同課程在学中

### 職歴

2005 年 9 月 ~ 2006 年 11 月 金融庁金融研究研修センター専門研究員

2006 年 10 月 ~ 2007 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科 TA (統計学入門)

2007 年 10 月 ~ 2008 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科 TA (統計学入門)

2008 年 6 月 ~ 2008 年 9 月 一橋大学大学院経済学研究科 TA (統計学)

2009 年 4 月 ~ 現在 一橋大学経済研究所 COE フェロー

### 研究業績

#### 出版済みの論文

Owari (2009a) “Robust Exponential Hedging in a Brownian Setting”, *JSIAM Letters*, Vol. 1, pp 64-67 [査読有].

#### 投稿中の論文・プレプリントなど

Owari (2007) “Robust Exponential Hedging and Robust Projections of Probability Measures with Linear Penalty”, 『JAFEE 冬季大会予稿集』, 241-259 [査読なし].

Owari (2008a) “Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation”, 『第 57 回理論応用力学講演会講演論文集』, 539-540 [査読なし].

Owari (2008b) “Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation”, *submitted*. A preprint version is available as: Discussion Paper No. 2008-09, Graduate School of Economics, Hitotsubashi Univ., <http://hdl.handle.net/10086/16932> [査読なし].

Owari (2009b) “A Note on Utility Maximization with Unbounded Random Endowment”, *submitted*. A preprint version is available as: Global COE Hi-Stat Discussion Paper Series No. 91, Institute of Economic Research, Hitotsubashi University, <http://hdl.handle.net/10086/17756>, [査読なし].

Owari (2010) “Robust Utility Maximization with Unbounded Random Endowment”, *in preparation*, [査読なし].

学会報告 (事前審査有のものには \*)

1. A Note on Utility Maximization with Unbounded Random Endowment, JAFEE 冬季大会, 明治大学, 2009 年 12 月.
2. Robust Utility Maximization with Random Endowment and Indifference Valuation, Workshop on Mathematical Economics 2009, Keio Univ. 2009 年 11 月.
3. Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation, Talks in Financial and Insurance Mathematics, Department of Mathematics, ETH Zürich, 2009 年 3 月.
4. Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation, First Florence-Ritsumeikan Workshop on Finance and Risk Theory, Università degli Studi di Firenze (University of Florence), Firenze, 2009 年 3 月.
5. Robust Exponential Hedging in a Brownian Setting, 日本応用数理学会 春の研究部会連合発表会, 京都大学, 2009 年 3 月.
6. On Exponential Hedging under Model Uncertainty, Recent Developments in Finance and Econometrics, 琉球大学, 2009 年 2 月.
7. Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation, 数理ファイナンスとその周辺, 九州大学, 2009 年 1 月
8. On Robust  $f$ -Projection with Unbounded Penalty, 経済統計ワークショップ, 一橋大学大学院経済学研究科, 2008 年 10 月.
9. Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation, 第 57 回理論応用力学講演会, 日本学術会議, 2008 年 6 月.
10. Robust Exponential Hedging and Indifference Valuation, 数理ファイナンス水曜セミナー, 東京大学大学院数理科学研究科, 2008 年 5 月.
11. モデルの不確実性の下での指数型ヘッジングと効用無差別評価, 日本応用数理学会 平成 20 年度研究部会連合発表会, 首都大学東京, 2008 年 3 月.
12. Robust Exponential Hedging and Robust Projections of Probability Measures with Linear Penalty, JAFEE 冬季大会, 中央大学, 2007 年 12 月.
13. Robust Exponential Hedging and Robust Projections of Probability Measures with Linear Penalty, 経済統計ワークショップ, 一橋大学大学院経済学研究科, 2007 年 11 月.
14. Pricing and Hedging Contingent Claims under Incompleteness and Uncertainty, 経済統計ワークショップ, 一橋大学大学院経済学研究科, 2006 年 12 月.

照会先

高橋 一 (一橋大学大学院経済学研究科教授) 高岡 浩一郎 (一橋大学大学院商学研究科准教授)