

高橋 一

TAKAHASHI, Hajime



学長

hajime@kankyo-u.ac.jp

Profile

研究者略歴

1971 (昭和46) 年 3月	一橋大学経済学部卒業
1978 (昭和53) 年 5月	コロンビア大学博士課程修了 (Dept. of Mathematical statistics) .
1977 (昭和52) 年 9月	ミシガン大学アンアバー校 Visiting Assistant Professor (Dept. of Statistics)
1979 (昭和54) 年 9月	ボストン大学 Assistant Professor (Dept. of Mathematics)
1982 (昭和57) 年 9月	富山大学経済学部助教授
1986 (昭和61) 年 4月	一橋大学経済学部助教授
1988 (昭和63) 年 4月	一橋大学経済学部教授, 大学院経済学研究科教授 (1998年~)
2000 (平成12) 年 4月	一橋大学大学院国際企業戦略科教授 兼任 (~ 2005年3月)
2001 (平成13) 年 4月	一橋大学大学院経済研究科長・学部長 (~ 2003年3月)
2009 (平成21) 年 11月	シンガポール経営大学ビジネススクール客員教授
2010 (平成22) 年 4月	一橋大学名誉教授、経済学研究科特任教授 事業創造大学院大学教授
2012 (平成24) 年 4月	鳥取環境大学経営学部経営学科教授、同副学長
2014 (平成26) 年 4月	公立大学法人鳥取環境大学理事長・学長
2015 (平成27) 年 4月	公立大学法人公立鳥取環境大学理事長・学長

Research

取得学位	Ph.D. (Mathematical Statistics) Columbia大学
専門分野	統計ファイナンス、数理統計学
現在の研究テーマ	・企業の債務不履行確率の統計学的解析 (Impliedデータの統計解析論) ・リスクな債券の信用リスクと流動性に関する理論研究と実証分析 ・有限母集団に於ける漸近理論とBootstrapへの応用
受賞歴	Fusion 2015 Best Paper ISIF/IEEE Miri,Chang,Chong JAFEE学会賞 (2015)
所属学会	日本統計学会, International Statistical Institute, The Institute of Mathematical Statistics, American Statistical Association, 日本金融・証券計量・工学学会 (JAFEE)

Data

研究等活動

【論文】

- ・"Applying Interacting Multiple Model to Financial Asset Allocation"(2017) (with Mori, Chang, Chong) to appear J. of Advances Info. Fusion
- ・"Statistical analysis of implied data"(2011) Asia Pacific Financial Journal
- ・"Smoothed versions of statistical functional from a finite population" (2009) (with Hitoshi Motoyama) Journal of the Japan Statistical Societies
- ・"On Pricing Exponential Square Root Barrier Knockout European Options," Asia-Pacific Financial Market, 2002 (with Morimoto) ・"A Note on Interaction between Markets Financial Markets," Asia-Pacific Financial Markets, 2000 ・"A Note on Edgeworth Expansions for the von Mises Functionals," Journal of Multivariate Analysis, 1988, ・Asymptotic Expansions in Anscombe's Theorem for Repeated Significance Tests and Estimation after Sequential Testing," Annals of Statistics, Vol.15, 1987

【著作・編著】

- ・『経済学とファイナンスのための数学、新世社』(1999)
- ・『金融・証券計量分析の基礎と応用』(共著, 刈屋武昭編) 東洋経済新報社, 1990年
- ・『計量経済学』(編) 八千代出版, 1993年
- ・『金融工学の新展開』ジャフィージャーナル[2001] (編) 東洋経済新報社, 2001年
- ・『金融工学と資本市場の計量分析』ジャフィージャーナル[2003] (池田昌幸氏との共編)

【学会報告等】

- ・"A Note on Pricing Illiquid Assets"(with Tobe), Symposium on Financial Engineering and ERM 一橋大学 2013年3月
- ・"On a Statistical Analysis of Implied Data" 2009年11月 Institute of Mathematical Statistics, Workshop on Risk Measures and Robust Optimization in Finance, Singapore, Invited talk.
- ・"On Pricing Exponential Square Root Barrier Knockout Options: Discrete Time Case" 8th China-Japan Symposium on Statistics, Guilin 2004年10月
- ・"非完備市場に於けるプライシング"2006年 JAFEE 2006 夏季大会, 会長講演

社会貢献活動

- ・地方公共団体の財政分析等に関する調査研究 (委員) 平成17年 自治総合センター