

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	コロンビア大学数理統計学部博士課程修了 Ph.D. Math. Std.
1977 (昭和52) 年 9月	ミシガン大学アンアバー校統計学部 Visiting Assistant Professor
1979 (昭和54) 年 9月	ボストン大学数学学部 Assistant Professor
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 (~ 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

■ 取得学位

Ph.D. (Mathematical Statistics) Columbia大学

■ 専門分野

派生証券価格理論, Impliedデータの統計解析論, Bootstrap, 非線形更新理論

■ 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
- ・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
- ・金利の期間構造の変化に関する研究
- ・有限母集団に於ける漸近理論とBootstrapへの応用

■ 所属学会

日本統計学会, International Statistical Institute, Te Institute of Mathematical Statistics, American Statistical Associaton, 日本金融・証券計量・工学会 (JAFEE)

Research

■ 研究等活動

【論文】

- ・"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』 ジャフイージャーナル[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』 ジャフイージャーナル[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
- ・"On Pricing Exponential Square Root Barrier Knockout Options," (with Morimoto)Columbia-Jafee 金融工学国際会議, 第一生命ホール (東京), 2000年12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

Data