

Hosted by Keio University Graduate Schools of Economics and of Business and Commerce, the Kyoto University Institute of Economic Research, the Tokyo Center for Economic Research, and the Keio-Kyoto Joint Global COE Program

10th Biennial Pacific Rim Conference
Western Economic Association International (WEAI)

2003年 ノーベル経済学賞受賞者
Robert Engle教授 特別講演会
“GLOBAL FINANCIAL STABILITY AND
SYSTEMIC RISK TODAY”



略歴

ロバート・エンゲル氏
(Robert F. Engle,
New York University)
アメリカ合衆国の経済
学者。時系列分析手
法の確立によってクラ
イヴ・グレンジャーとと
もに2003年のノーベル
経済学賞を受賞した。

WEAI事務局のご厚意により、基調講演として開催されるエンゲル教授の講演会に慶應義塾生・京都大学生は無料で参加できることになりました。*使用言語は英語のみで通訳はありませんのでご了承ください。

慶應義塾大学
南校舎
南ホール

3/16
2:45PM-
4:15PM

入場
2:30PM

特別講演参加費：慶應義塾生・京都大学生は聴講無料。

その他のWEAIセッションの聴講には参加費が必要です。詳しくはWEAIウェブサイトをご確認ください。

WEAIウェブサイト：<http://www.weai.org/index.html>

申し込み先着：100名。会場の収容人数の都合により、立ち見となる可能性もございますのでご了承ください。

お申込み：希望者は3月10日までに下記アドレスに①～④を明記し受付アドレスに送信ください。(メール申込のみ)

①氏名 ②学年 ③大学名・所属学部/学科 ④e-mailアドレス

件名：WEAI 講演会参加希望 受付アドレス：mita-office@kier.kyoto-u.ac.jp

お問い合わせ：WEAI2013日本事務局：岡村 075-753-7185

エンゲル教授 略歴

ロバート・エンゲル氏は、ニューヨーク州シラキュース生まれのアメリカ人経済学者。時系列分析手法の確立によってクラウグ・グレンジャーとともに 2003 年のノーベル経済学賞を受賞しました。

ロバート・エンゲル氏の最も大きな業績は、金融市場や金利など予測不能な動きの分析法を確立したことです。これらの不安定な動きの正確な予測は、経営リスクの適切な管理に不可欠のもので、リスクマネジメントはオプション価格やデリバティブに重要な役割を果たします。

エンゲル氏は、1982 年、高い不安定性と低い不安定性の間で動く株価や他の金融変数のデータなどの分散不均一性を示す時系列データをみつかる、新しい統計モデル (ARCH モデル、分散自己回帰モデル、分散不均一モデルなどという) を考案しました。これらの統計モデルは現代の価格理論などにおいて不可欠なものであります。

Western Economic Association International について

Western Economic Association International は、1922 年に発足し、アメリカの科学機関としては最も大きな機関の一つで、Economic Inquiry と Contemporary Economic Policy (年 4 回刊行のレフリー付きジャーナル) の刊行および、経済学研究のフォーラムとして学術会議の開催などの事業を行っています。

世界中の学術機関、経済界、官公庁から約 1,800 名の経済学者の会員を擁し、学会の会員には、ダグラス・C・ノース氏、ケニス・J・アロー氏、ジェームス・M・ブキャナン氏、ミルトン・フリードマン氏、ジェームス・J・ヘックマン氏、ロバート・J・バルロー氏など世界的にも著名な経済学者が含まれています。

Pacific Rim Conference について

Pacific Rim Conference は 1994 年からさまざまな都市で開催されており (直近では、2000 年: シドニー、2003 年: 台北、2005 年: 香港、2007 年: 北京)、アジア太平洋地域の経済研究・分析の促進を目的としております。

10th Biennial Pacific Rim Conference について

大会会期: 2013 年 3 月 14 日 (木) ~ 17 日 (土)

慶應義塾大学清家篤塾長のオープニングアドレス、ロバート・エンゲル教授 (ノーベル経済学賞受賞者) とジョージ・カーフマン教授 (WEAI 会長)、伊藤隆敏教授 (東京大学) の基調講演、清家篤塾長や伊藤隆敏教授が参加するパネルディスカッション、その他多数のセッションが行われ、各国から約 500 名が参加する国際学会です。

プログラムなど詳細につきましては、WEAI のウェブサイトをご覧ください。

<WEAI ウェブサイト> <http://www.weai.org/PacRimConf#TokyoTentativeSchedule>