

鹿児島大学数理情報科学談話会

第212回

日時：2016年7月7日(木) 16:10 - 17:40

場所：理学部1号館101室

講師：西口 健二氏 (日本総合研究所)

題目：金融ネットワークとシステムミックリスク

～部分からの全体への連鎖の数学的考察～

概要：2008年9月、米国の金融機関リーマンが破綻すると、その影響はまたたく間に拡散し世界中の多くの銀行が破綻の危機に晒された。21世紀になり金融機関の間のネットワーク構造が飛躍的に複雑になったことが背景にあり、個々の金融機関の行動が瞬時に連鎖して金融全体へ悪影響を与えるというシステムミックリスクの高まりを示すものであった。本講では、このような連鎖倒産のメカニズムについて数学的モデルを構成し、どのようなネットワーク構造の時に部分から全体に繋がりやすいかを分析する枠組みを解説する。さらに、演者自身が銀行で経験した様々な問題を紹介し、何が金融や銀行の本質かを数学的な視点から探ってみたい。

お問合せ：談話会委員 田中 恵理子 (✉ erico@sci.kagoshima-u.ac.jp ☎ 099-285-8988)