

JAFEE

1998

夏季大会 予稿集

7月10日(金)

7月11日(土)

於：一橋大学 佐野書院

日本金融・証券計量・工学学会

(The Japanese Association of Financial Econometrics and Engineering)

事務局

〒305 茨城県つくば市天王台1-1-1

筑波大学 社会工学系 高橋正文研究室

Tel./Fax. 0298-58-0233

7月10日(金)

報告時間はすべて30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:30-10:30 座長：箱田 啓一(大和証券)

我が国の機関投資家による株式取引の現状
吉川 真祐(日本証券経済研究所)

An Econometric Policy Evaluation of the Price Limit Regulations on Japanese
Stock Index Futures Market
高山 俊則(MTEC)

10:40-12:10 座長：高橋 一(一橋大学)

市場価格に基づく資産価格過程のインプライドツリーの構築法
白川 浩(東京工業大学)

Log Levy プロセス + CMM による価格付け理論
宮原 孝夫(名古屋市立大学)

On validity of the asymptotic expansion approach in contingent claim analysis
国友 直人(東京大学), 高橋 明彦(Long Term Capital)

12:10-13:40 昼休み, 理事会・評議員会

13:40-14:40 座長：中里 宗敬(青山学院大学)

Construction of an Implied-Forward-Libor-Rate-Model
関根 順(MTEC)

Mean-Risk-Skewness モデルと Stochastic Dominance の関係について
後藤 順哉(東京工業大学), 今野 浩(東京工業大学)

14:50-15:50 座長：広田 真人(東京証券取引所)

離散データによる厳密なポートフォリオ・パフォーマンス貢献度分析に関する考察
鹿島 浩之(日本興業銀行)

非線型オプティマイザーによる株式ポートフォリオの最適化 ~取引コスト, 投資金額,
投資期間の考慮~
田中 一嘉(大和証券)

16:00-17:30 座長：清水康司(青山学院大学)

変換モデルを用いた VaR 計測
三浦 良造(一橋大学), 大上 慎吾(一橋大学)

収益率の時系列構造と時間分散効果
諏訪部 貴嗣(野村証券)

非線型フィルターを用いた Volatility の推定
佐藤 整尚(統計数理研究所), 北川 源四郎(統計数理研究所)

17:40-19:40 懇親会(佐野書院)

7月11日(土)

報告時間はすべて30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:30-10:30 座長:大巻 一雄(さくら銀行)

クレジット・スワップの評価モデル
青沼 君明(東京三菱銀行)

Passport Option 評価について
長山 いづみ(東京三菱銀行)

10:40-12:10 座長:高橋 正文(筑波大学)

商品先物価格とコンビニエンスイールド
山内 浩嗣(一橋大学)

BGM金利モデルの適用と展開
神楽岡 優昌(MTEC)

Modeling individual US T-Bond prices
津田 博史(ニッセイ基礎研究所), 刈屋 武昭(一橋大学)

12:10-13:20 昼休み

13:20-14:20 特別セッション 司会:佃 良彦(東北大学)

「バリュエーション・リスク計測における統計的諸問題について」
三浦 良造(一橋大学)

14:30-16:00 座長:小暮 厚之(千葉大学)

格付け取得確率の推定と最適債券ポートフォリオ
中山 めぐみ(三菱総合研究所), 森平 爽一郎(慶應義塾大学)

インプライド倒産確率の推定:銀行の事例
斎藤 啓幸(日興証券), 森平 爽一郎(慶應義塾大学)

オプション・プライシング・アプローチとニューロ・ファジー・モデルでの倒産予測可能性の実証研究
阿竹 敬之(日興証券)

16:10-17:10 座長:津田 博史(ニッセイ基礎研究所)

状態のフラクタル次元を用いた株価変動解析とそのポートフォリオセレクションへの適用可能性について
松岡隆志(東京理科大学)

財務データからの相関を考慮したデータマイニング

森本 康彦(日本IBM), 福田 剛志(日本IBM), 松澤 裕史(日本IBM),
徳山 豪(日本IBM)