

JAFEE

2004

冬季大会 プログラム

12月23日(木)

12月24日(金)

於：学術総合センター内 一橋記念講堂

日本金融・証券計量・工学学会

(The Japanese Association of Financial Econometrics and Engineering)

事務局

〒101-8439 東京都千代田区一ツ橋 2-1-2 学術総合センター8F
一橋大学大学院国際企業戦略研究科 三浦良造研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

12月23日(木)

報告時間 25分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:30-11:10 実証分析 座長:山内 浩嗣(株式会社エムティービー インベストメント テクノロジー研究所)

投資家の相互作用と市場のダイナミクス

吉田 直子(メリルリンチ日本証券), 中里 宗敬(青山学院大学), 高山 俊則(みずほ総合研究所)

EVA と株価騰落率の実証研究

水野 伸昭(UFJ銀行)

Investor Biases in Japan: Another Pathology of the Keiretsu System

平木 多賀人(関西学院大学), 井上 英明(日本生命保険), 伊藤 彰敏(University of Regina),
黒木 文明(ニッセイ基礎研究所), 増田 裕行(ニッセイ基礎研究所)

順序プロビット型3層パーセプトロンの階層ベイズモデルによる社債格付分析

須田 宏(三井住友銀行)

11:20 -12:35 金利デリバティブ 座長:中川 秀敏(東京工業大学理財工学研究センター)

An Efficient Calibration Method for the Multi-Factor Libor Market Model and Its Application to the Japanese Market

谷村 英俊(新日本監査法人・筑波大学大学院), 山田 雄二(筑波大学大学院ビジネス科学研究科)

A Review for Pricing Problems of Options on Defaultable Bonds

室井 芳史(東京大学大学院経済学研究科)

Various Features of the Chooser Flexible Cap

丹波 靖博(大阪大学大学院経済学研究科), 大西 匡光(大阪大学大学院・京都大学大学院)

12:35-14:00 昼休み, 理事会・評議員会

14:00-15:00 特別講演 司会:塚原 英敦(成城大学経済学部)

TBA

Freddy Delbaen(Department of Mathematics, ETH Zurich)

15:10 -16:50 不完備市場 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

不連続株価過程に対する Variance-Optimal Martingale Measure について

新井 拓児(東京理科大学理工学部)

On the Verification Theorem of Continuous-Time Optimal Portfolio Problems with Stochastic Market Price of Risk

本多 俊毅, 上村 昌司(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Volatility Smile/Smirk Properties of [GLP & MEMM] Models

宮原 孝夫(名古屋市立大学大学院), 森脇 成彦(名古屋市立大学大学院)

Cumulant Based Finite Difference Approximations for Option Valuation and Hedging under Levy Processes

山田 雄二(筑波大学大学院ビジネス科学研究科), James A. Primbs(Stanford University)

17:00 -17:50 オペレーションズ・リサーチ 座長:山田 雄二(筑波大学大学院ビジネス科学研究科)

平均・分散・歪度モデルの効率的解法と評価

山本 零(エムティービー インベストメントテクノロジー研究所・中央大学大学院), 今野 浩(中央大学)

ニューラルネットを活用した従来型テクニカル分析手法の改善の試み

馬場 則夫(大阪教育大学), 野村 俊智(大阪教育大学)

18:00-19:00 総会

19:00-20:30 懇親会

12月24日(金)

報告時間 25分 (質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:15 -10:55 統計的方法 座長:大上 慎吾(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

KM₂O-ランジュヴァン方程式論に基づく非線形予測解析と異常性分析への応用

鈴木 健二郎(東京大学大学院情報理工学系研究科)

下方部分積率にもとづく可変ヘッジの適用

森田 充(九州大学大学院)

高次積率に対する確率ボラティリティモデルの拡張

福井 昭吾(九州大学大学院経済学研究院)

SV-VAR モデルによる気温リスク・スワップの検証

刈屋 武昭(明治大学大学院ビジネススクール), Tee KianHeng(京都大学経済研究所),

郷古 浩道(京都大学大学院経済学研究科)

11:05 -12:20 プリペイメントリスク 座長:津田 博史(株式会社ニッセイ基礎研究所)

生存時間モデルを用いた小口割賦債権の期限前返済リスクに関する実証

鈴木 隆之(みずほ信託銀行)

住宅金融公庫 MBS の評価

野崎 真利(エムティービー インベストメント テクノロジー研究所)

Intensity-based アプローチによるデフォルト・リスクのある RMBS の評価

杉村 徹(一橋大学大学院・三菱証券)

12:20-13:10 昼休み

13:10 -14:10 金融商品特別セッション:為替オーバーレイ取引

司会:廣中 純(野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社)

TBA

中窪 文男(ニッセイ基礎研究所)

TBA

森谷 博之(住商キャピタルマネジメント)

14:15 -15:05 計算結果報告セッション 座長:石井 昌宏(大東文化大学経営学部)

日経225オプションの織り込む株価過程の連続成分とジャンプ成分

野村 哲史(電気通信大学大学院), 宮崎 浩一(電気通信大学)

Identification of Parabolic Type Factor Model -Empirical Study of US Treasury Bonds-

相原 伸一(諏訪東京理科大学), BAGCHI Arunabha(FELab, Twente University)

15:15 -16:30 プライシング 座長:高岡 浩一郎(一橋大学大学院商学研究科)

償還条項付きアメリカンオプションの評価について

澤木 勝茂(南山大学数理情報学部数理科学科), 瀬古 進(南山大学経営学研究科)

A Structural Model for Electricity Prices with Spikes - Measurement of Jump Risk and Optimal Policies for Hydropower Plant Operation -

金村 宗, 大橋 和彦(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Optimal Risk Transfer and Investment Policies Based upon Stochastic Differential Utilities

中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

会場案内

学術総合センター

〒101-8439 東京都千代田区一ツ橋 2-1-2

