

JAFEE

2008

冬季大会 プログラム

1月29日(木)

1月30日(金)

於：筑波大学 東京キャンパス大塚地区 G501大講義室

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 金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

1月29日(木)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00 - 11:30 最適化 座長: 枇々木 規雄(慶應義塾大学 理工学部)

整数計画法を用いたファクター選択による決定係数最大化ポートフォリオの構築と評価

山本 零((株)三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)、中央大学),

高屋 仁寛(中央大学大学院 理工学研究科 修士課程), 今野 浩(中央大学 理工学部)

取引コストを考慮したコンスタント・リバランス・ポートフォリオ最適化

高野 祐一(筑波大学 システム情報工学研究科),

後藤 順哉(中央大学 理工学部 経営システム工学科)

マルコフ連鎖上の多数回最適停止問題の解法とその幾何ランダムウォーク上のフローティング・ス
トライクを持つ多数回行使可能型ラシアン・アジアノプションへの応用 -離散時間の場合-

穴太 克則

11:30 - 13:00 昼休み, 理事会・評議員会

13:00 - 13:30 総会

13:40 - 15:10 金利の期間構造 座長: 宮崎 浩一(電気通信大学 電気通信学部 システム工学科)

Parameter Identification of Affine Term Structures from Yield Curve Data

相原 伸一(諏訪東京理科大学 システム工学科),

Arunabha Bagchi (University of Twente)

物価連動国債の価格付けモデルの構成と実証分析

宮本 学(みずほ証券株式会社 金融市場グループ 金融市場部)

日本の債券市場の流動性スプレッド

王 京穂(明治大学大学院 グローバルビジネス研究科), 岡崎 正樹(同左)

15:20 - 16:20 市場リスク 座長: 大上 慎吾(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

市場 VaR 計測の問題点とパラメトリック法による改善

久保田 幸長(日本銀行 金融研究所)

Using Non-normal Distributions to Analyze the Relationship between Stock Returns in
Japan and the U.S.

永原 裕一(明治大学 政治経済学部)

16:30 - 18:00 信用リスク 座長: 津田 博史(同志社大学 理工学部 数理システム学科)

An Application of Merton's Portfolio Selection Problem to the Case with a Defaultable
Asset

梁 云(東京工業大学大学院 イノベーションマネジメント研究科 博士後期課程)

漸近展開による信用派生商品の価格付け: 確率スプレッドをもつ格付けモデル

瀧野 一洋(大阪大学大学院 経済学研究科 博士後期課程),

室井 芳史(大阪大学 金融・保険教育研究センター 大阪証券取引所寄付研究部門)

On an Enhanced Credit Scoring Model and its Tuning Method Using Multi-Objective GA

山内 浩嗣((株)三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

18:30 - 20:30 懇親会(於: 茗溪会館)

1月30日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00 - 11:30 マーケット分析 座長:石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科)

格付けはリバーサルリターンを本当に説明するのか? -日本株式市場からのエビデンス-
佐々木 大輔(電気通信大学大学院 電気通信学研究科 システム工学専攻 修士課程),
宮崎 浩一(電気通信大学 電気通信学部 システム工学科)

ポリシー・アセット・アロケーションの説明力
小松原 幸明(イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社)

On Entropy, Financial Markets and Minority Games
Zapart Christopher (統計数理研究所)

11:30 - 12:00 会長企画特別セッション

司会:森棟 公夫(京都大学大学院 経済学研究科)

講演:「サブプライム問題と金融工学」
刈屋 武昭(明治大学大学院 グローバルビジネス研究科 教授)

12:00 - 13:00 昼休み

13:00 - 14:30 金融商品特別セッション: セッションテーマ「日本の金融市場に何が必要か」

司会:中川 秀敏(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

講演1:「金融工学を巡る諸問題について」
高橋 洋一(東洋大学 経済学部 総合政策学科 教授)

講演2:「投資活動の必要十分条件」
能見 公一(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科 国際経営戦略コース 特任教授)

14:50 - 16:20 動的最適化 座長:中野 張(東京工業大学大学院 イノベーションマネジメント研究科)

経済環境の不確実性を有する負債に対応する多期間動的最適化
門田 伸一(野村証券株式会社)

Optimal Execution in an Evolutionary Setting
石井 良輔(京都大学 経済研究所 学振PD)

Robust Delegated Portfolio Management with Model Uncertainty
中村 信弘(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

16:30 - 18:00 派生証券価格評価 座長:中村 信弘(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

長寿リスク証券化商品のプライシング -ベイジアン・アプローチによる評価-
倉知 善行(東京大学大学院 経済学研究科 金融システム専攻 修士課程),
小暮 厚之(慶應義塾大学 総合政策学部)

放物型偏微分方程式の積分曲線上における有限差分法と派生証券の価格計算への応用
藤原 武弘(日本銀行 金融研究所)

Optimal Hedging Using Additive Models
山田 雄二(筑波大学大学院 ビジネス科学研究科)

会場案内

筑波大学 東京キャンパス大塚地区 G501大講義室

〒112-0012 東京都文京区大塚3-29-1



- 東京メトロ 丸ノ内線 茗荷谷(みょうがだに)駅 「出口1」より徒歩2分

2008年12月22日発行

発行 日本金融・証券計量・工学学会(**JAFEE**)

制作 〒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

金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当