

JAFEE

2009

夏季大会 プログラム

7月29日(水)

7月30日(木)

於：法政大学 市ヶ谷キャンパス 富士見校舎内
ボアソナード・タワー スカイホール

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

7月29日(水)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00 - 11:30 市場での価格形成の分析 石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科)

Evolutionary Sequential Trading
石井 良輔(財団法人 知的財産研究所)

実市場データをもとにポートフォリオ運用を行うエージェントを用いた人工市場による株価予測
水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント),
和泉 潔(産業技術総合研究所 デジタルヒューマン研究センター)

人工市場を用いた株式市場安定化策としての空売り規制の有効性検証
八木 勲(東京工業大学大学院 総合理工学研究科 知能システム科学専攻),
水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント),
和泉 潔(産業技術総合研究所 デジタルヒューマン研究センター)

11:30 - 13:00 昼休み, 理事会・評議員会

13:00 - 13:30 総会

13:40 - 14:40 オルタナティブ資産 座長:大橋 和彦(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

Convenience Yield-Based Pricing of Commodity Futures
金村 宗(J-POWER)

不動産価格:理論と実証
石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科), 前田 章(京都大学大学院 エネルギー科学研究科),
廣兼 匡章(大阪大学大学院 基礎工学研究科), 白旗 慎吾(同左), 坂本 亘(同左),
谷山 智彦(大阪大学大学院 経済学研究科), 渡部 育恵

14:50 - 16:20 時系列データ分析 座長:中妻 照雄(慶應義塾大学 経済学部)

時系列長が実証的相関行列の固有値分布に与える影響
西岡 謙太(京都大学大学院 情報学研究科 数理工学専攻), 佐藤 彰洋(同左)

テキストマイニング手法による月次市場分析
和泉 潔(産業技術総合研究所 デジタルヒューマン研究センター),
後藤 卓(三菱東京UFJ銀行 市場企画部),
松井 藤五郎(とうごろう機械学習研究所)

MCMC 法による自己回帰型株価リターン予測の効果分析
木村 哲(明治大学大学院 グローバル・ビジネス研究科),
伊藤 智彌(アイ・ビー・テクノス, 明治大学大学院 グローバル・ビジネス研究科 修士課程)

16:30 - 18:00 数理ファイナンス 座長:室井 芳史(東北大学大学院 経済学研究科)

Risk Sensitive Value Measure and its Applications
宮原 孝夫(名古屋市立大学 経済学研究科)

Robust Portfolio Strategies in a Stochastic Volatility Model: A Distortion Solution Approach
中村 信弘(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

数値計算解: CRR 市場上の多数回行使可能オプション
穴太克則, 平出 涼(東京工業大学 大学院情報理工学研究科 数理・計算科学専攻)

7月30日(木)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

8:40 大会受付

9:00 - 10:00 コーポレート・ファイナンス 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

日本の買収防衛策導入と市場評価

奥原 早苗(多摩大学大学院 経営情報学研究科 経営情報学専攻 博士課程前期)

低金利下における企業の投資行動と信用リスク

山田 哲也(日本銀行 金融研究所)

10:10 - 11:10 ポートフォリオ最適化 座長:枇々木 規雄(慶應義塾大学 理工学部)

公的年金運用における基本ポートフォリオ策定プロセスの再考について 一多期間最適化モデルの活用一

上崎 勝己(三菱UFJ信託銀行), 山本 零(三菱UFJトラスト投資工学研究所, 中央大学理工学部)

ノルム制約を課した CVaR 偏差最小化トラッキング・ポートフォリオ

後藤 順哉(中央大学 理工学部 経営システム工学科),

武田 朗子(慶應義塾大学 理工学部 管理工学科)

11:20 - 12:20 信用リスク1 座長:吉羽 要直(日本銀行 金融研究所)

小企業向けスコアリングモデルにおける業歴の有効性

枇々木 規雄(慶應義塾大学 理工学部),

尾木 研三(日本政策金融公庫 国民生活事業本部 リスク管理部), 戸城 正浩(同左)

On Credit and Surrender Risks in Insurance Companies

Olivier le Courtois (EM Lyon Business School, France),

中川 秀敏(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

12:20 - 13:20 昼休み

13:20 - 14:50 金融商品特別セッション: セッションテーマ「混迷する市場環境における投資戦略」

司会:石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科)

講演1:「米国商業不動産担保証券(CMBS)市場の現状」

進藤 久佳(野村証券金融工学研究センター シニア・クオンツ・アナリスト)

講演2:「年金資産運用における株式クオンツ運用の動向(仮題)」

鈴木 英典(JPモルガン・アセット・マネジメント 投資戦略ソリューション室長)

15:00 - 16:30 信用リスク2 座長:津田 博史(同志社大学 理工学部 数理システム学科)

Recovery Process Model for Two Companies

伊藤 有希(一橋大学大学院 経済学研究科 博士課程)

ハザード率と回収資産の負の相関を考慮した期待損失: CIR型ハザード率過程を用いた解析的な評価

吉羽 要直(日本銀行 金融研究所), 山下 智志(統計数理研究所)

An Application of Top-down Approach for Credit Loan Portfolio Based on Ratings Process

金子 拓也(日本銀行 金融研究所), 中川 秀敏(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

16:40 - 18:10 リスク管理 座長:青沼 君明(三菱東京UFJ銀行 融資企画部)

仕組債投資における減損処理リスクとその簡易評価法

安岡 孝司(芝浦工業大学大学院 工学マネジメント研究科)

A Method of Estimating Mixture of Multivariate Nonnormal Distributions

永原 裕一(明治大学 政治経済学部)

銀行の流動性預金残高と満期の推定モデル

上武 治紀(りそな銀行 リスク統括部 金融テクノロジーG), 枇々木 規雄(慶應義塾大学 理工学部)

会場案内

法政大学 市ヶ谷キャンパス 富士見校舎内
ボアソナード・タワー スカイホール(26階)

東京都千代田区富士見2-17-1



<JRをご利用の場合>

JR総武線「飯田橋」駅・「市ヶ谷」駅 各徒歩10分

<地下鉄をご利用の場合>

東西線・南北線・有楽町線・都営大江戸線「飯田橋」駅 各徒歩10分程度

有楽町線・南北線・都営新宿線「市ヶ谷」駅 各徒歩10分程度

2009年6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