

JAFEE

2012

夏季大会 プログラム

2012年8月3日(金)

2012年8月4日(土)

於：成城大学 3号館 322教室

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 03-4212-3112

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

2012年8月3日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付開始

9:30 -10:30 オルタナティブ投資 座長:石井 昌宏(上智大学経済学部)

Market Risk, Credit Risk, and Futures Trading in Commodity Markets
金村 宗(J-POWER)

不動産ファンダメンタル・ベータ: 不動産投資における市場リスクのファクターモデル
石島 博(中央大学大学院国際会計研究科)
前田 章(東京大学教養学部附属教養教育高度化機構)
谷山 智彦(株式会社野村総合研究所)

10:45 -11:45 ボラティリティ 座長:山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

代理変数を用いたボラティリティ予測評価に関する考察
永田 修一(関西学院大学理工学部数理科学科)
大屋 幸輔(大阪大学大学院経済学研究科, 金融・保険教育研究センター)

実現ボラティリティによって標準化された株価収益率における有限サンプリング効果
高石 哲弥(広島経済大学経済学部教養教育)

11:45-13:15 昼休み, 理事会・評議員会(於:32A教室)

13:15-13:45 総会

14:00 -15:30 市場変動リスク 座長:石島 博(中央大学大学院国際会計研究科)

Intraday Technical Analysis of Individual Stocks on the Tokyo Stock Exchange
山本 竜市(台湾国立政治大学国際経営学部)

超過共変動の時系列特性分析
徳永 俊史(武蔵大学経済学部)
山本 零(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

板情報を用いた株式市場の状態変化の分析
梅岡 利光(名古屋大学大学院情報科学研究科), 鳥海 不二夫(東京大学大学院工学研究科)
石井 健一郎(名古屋大学大学院情報科学研究科), 間瀬 健二(同左)

15:45 -17:15 ポートフォリオ 座長:西出 勝正(横浜国立大学大学院国際社会科学部)

A Model Predictive Control Approach for Portfolio Optimization with Cointegrated Pairs of Stocks

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)
James A. Primbs(Management Science and Engineering, Stanford University)

クオンツ運用における合成アルファとポートフォリオリバランス
南 聖治(りそな銀行アセットマネジメント部)

実質次元減少法によるQMCを用いたポートフォリオのリスク指標の推定
鈴木 悠也(慶應義塾大学大学院理工学研究科), 今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

17:45-19:45 懇親会(於:SEIJO LOUNGE(7号館地下))

2012年8月4日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付開始

9:30 -10:30 債券価格分析 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

ノンパラメトリック手法と業者間市場データを用いたイールドカーブの推定

阿部 卓哉(日本相互証券株式会社), 佐々木 正信(株式会社富士通総研)

松岡 英俊(株式会社富士通研究所), 池田 弘(同左)

決算情報が社債市場に与える影響

上瀧 弘晃(三井住友信託銀行), 山下 泰央(同左), 高橋 大志(慶應義塾大学大学院経営管理研究科)

10:45 -11:45 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)

システムティック・ファクターを考慮した確率的な回収率の下でのポートフォリオ・クレジット・デリバティブ評価

大谷 祐子(慶應義塾大学大学院理工学研究科), 今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

Randomized Merton モデルおよびその改良に基づく社債スプレッドの実証分析

瀬戸口 智美(損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社),

中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

11:45-12:45 昼休み

12:45 -14:15 金融商品特別セッション:「日本国債の行方」

司会:廣中 純(野村アセットマネジメント リーガル・コンプライアンス部)

講演1:日本国債のリスクに関するマクロ的展望

木村 俊夫(三井住友信託銀行 調査部 経済調査チーム長)

講演2:ある国債投資担当者から見た日本国債のソプリン・リスク

佐藤 元彦(明治安田生命 証券運用部 債券運用グループ GM)

14:30 -15:30 派生商品 I 座長:中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Time-changed Lévy 過程の下でのアメリカンオプションの評価

杉浦 大輔(慶應義塾大学大学院理工学研究科), 今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

An Approach to the Option Market Model based on the End-User Net Demand

佐々木 洋(一橋大学大学院国際企業戦略研究科 博士後期課程)

15:45 -16:45 派生商品 II 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

An Asymptotic Expansion for Solutions of Cauchy-Dirichlet Problem for Second Order Parabolic PDEs and its Application to Pricing Barrier Options

加藤 恭(大阪大学大学院基礎工学研究科), 高橋 明彦(東京大学大学院経済学研究科)

山田 俊皓(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC), 東京大学大学院経済学研究科)

On a Symmetrization of Diffusion Processes and a Numerical Scheme Based on Semi-Static Hedging Strategy

今村 悠里(立命館大学理工学部)

17:00 -18:00 リスク管理 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

A Note on Risk Measure Theory from a Category-Theoretic Point of View

足立 高德(一橋大学大学院国際企業戦略研究科 博士後期課程)

Modeling and Estimation of Dynamics Pairs Trading using Stochastic Volatility Model and Bayesian Inference

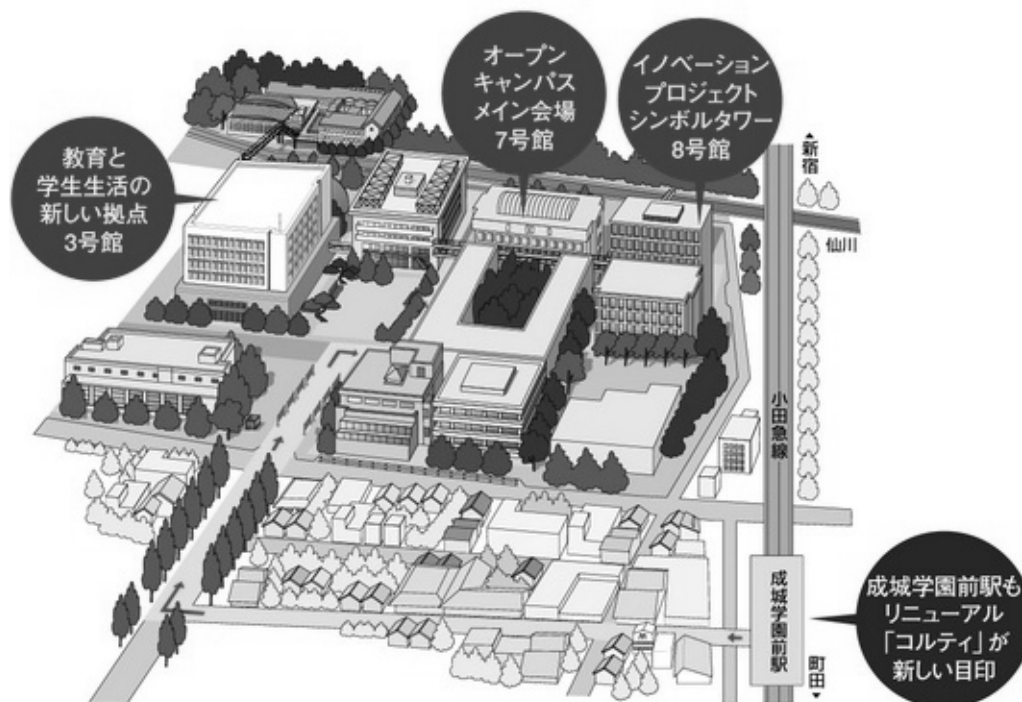
Napoleon(一橋大学国際企業戦略研究科)

中村 信弘(一橋大学国際企業戦略研究科)

会場案内

成城大学 3号館 322教室

〒157-8511 東京都世田谷区成城6-1-20



■小田急線・成城学園前駅 正門まで下車徒歩3分

2012年6月27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 03-4212-3112

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当