

JAFEE

2013

冬季大会 プログラム

2014年1月10日(金)

2014年1月11日(土)

於：慶應義塾大学 三田キャンパス
北館・ホール／大会議室

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

1月10日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む) 第1日目のセッションはすべて「北館・ホール」で行われます。

9:00 大会受付

9:30 -10:30 市場分析手法 座長: 林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科)

ダーク・プールは金融市場を安定化しマーケット・インパクトを低減させるか? ~人工市場シミュレーションを用いた検証~

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント、東京大学大学院工学系研究科),
小杉 信太郎(野村証券), 楠本 拓矢(同左), 松本 渉(同左)
和泉 潔(東京大学大学院工学系研究科、科学技術新興機構 CREST),
吉村 忍(東京大学大学院工学系研究科)

New Prospect Ratio of Hedge Funds with Higher Order Moments
渡辺 泰明(大阪大学大学院経済学研究科、近畿大学世界経済研究所)

10:45 -12:15 ポートフォリオ・マネジメント 座長: 磯貝 明文(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

相似拡大的頑健効用と2ファクター・アフィン・モデルに基づく消費と株式指数・全満期国債投資の多期間最適化問題における2種類の近似解析解

楠田 浩二(滋賀大学経済学部)

高次モーメント型CAPM: t-共変動を用いた実証分析

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系),
吉野 貴晶(大和証券株式会社 投資戦略部), 齊藤 哲朗(同左)

Tail Risk Parity/Budgeting Investment: Copula Approach to Tail Dependence Structure
中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

12:15-13:45 昼休み、理事会・評議員会(北館1F会議室)

13:45-14:15 総会

14:20 -15:20 ボラティリティ分析 座長: 中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

粒子フィルタによる無裁定条件を考慮した Equity Implied Volatility Surface の推定について
篠田 宜明(みずほ証券), 中村 尚介(同左)

Forecasting Financial Market Volatility Using a Dynamic Topic Model
山内 海渡(関西学院大学理工学研究科), 森本 孝之(関西学院大学理工学部)

15:35 -17:05 リスク管理 座長: 塚原 英敦(成城大学経済学部)

社債価格に基づく米国エネルギー産業の信用リスク分析

田野倉 葉子(明治大学先端数理科学研究科), 刈屋 武昭(明治大学グローバルビジネス研究科),
山村 能郎(明治大学グローバルビジネス研究科), 王 竹(ZWシステム)

Risk Evaluation of Mortgage-Loan Portfolios under Low Interest-Rate Environment

木島 正明(首都大学東京社会科学部),
鈴木 洋一(クレジット・プライシング・コーポレーション), 丹波 靖博(同左)

Recursive Utility Functions with Extended States

足立 高德(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

1月11日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

午前のセッションは、会場A「北館・ホール(1F)」と会場B「北館・大会議室(3F)」で行われます。
午後の設立20周年記念シンポジウムは、「北館・ホール」で行われます。

9:00 大会受付

9:30-10:30 第1セッション

(会場A) 信用リスク管理 I

座長: 中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Estimation of Default Probability under Real Probability Measure

高橋 一(鳥取環境大学大学院環境情報学研究所),
戸辺 玲子(早稲田大学ファイナンス研究センター)

Identification Problem in the Joint Estimation of Default Intensity and Recovery Rate using only Credit Default Swap Data

Sim Dara(大阪大学大学院経済学研究科), 大西匡光(同左)

(会場B) 派生商品 I

座長: 室井 芳史(東北大学経済学研究科)

A Bayesian Pricing of Longevity Derivatives under Stochastic Interest Rate

小暮 厚之(慶應義塾大学総合政策学部), 伏見 考弘(同左)

Pricing Basket Options Under Local Stochastic Volatility with Jumps

白谷 健一郎(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー),
高橋 明彦(東京大学大学院経済学研究科)

10:45-12:15 第2セッション

(会場A) 信用リスク管理 II

座長: 山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所)

Default or Exit?: Empirical Study on SMEs in the Japanese Construction Industry

紺野 由希子(横浜国立大学大学院国際社会科学研究所)

デフォルト率の状態変化とデフォルト判別モデルの有効性について

宮崎 絵理(日本リスク・データ・バンク/一橋大学大学院ICS),
沖本 竜義(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

システムック・リスク指標に関するサーベイ 一手法の整理とわが国への適用可能性一

内田善彦(日本銀行金融研究所), 菊池健太郎(日本銀行国際局),
丹羽文紀(日本銀行金融市場局), 服部彰夫(日本銀行金融研究所)

(会場B) 派生商品 II

座長: 新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

Bond Pricing under Regime Switching Among Several Short Rate Models

田中 敬一(首都大学東京社会科学研究所)

離散マリアン解析を用いたジャンプ拡散過程の下での Greeks 計算手法

室井 芳史(東北大学経済学研究科),
須田真太郎(三菱UFJトラスト投資工学研究所)

No-Arbitrage Bounds on Two One-Touch Options

都築 幸宏(東京大学大学院経済学研究科)

12:15-13:20 昼休み

13:20-18:15 JAFEE設立20周年記念シンポジウム「アジア・太平洋地域の経済発展と日本の未来」

司会 : 廣中 純(野村アセットマネジメント)

13:20~13:30 JAFEE 会長ご挨拶 津田 博史(同志社大学理工学部)

13:30~13:50 「金融面における成長戦略~アベノミクス「第三の矢」の一環として~」
福岡 資麿 氏(内閣府大臣政務官)

14:00~14:45 「日本の成長戦略と経済連携交渉: 現状と課題」
五嶋 賢二 氏(外務省経済局審議官)

14:50~15:35 「国際金融と世界経済」
櫻庭 千尋 氏(日本銀行国際局審議役)

16:00~16:45 「2015年の ASEAN 経済統合と日本企業の現地経営機能のあり方」
村田 佳生 氏(株式会社野村総合研究所 執行役員 コンサルティング事業本部副本部長)

16:50~17:35 「ベトナムの銀行の現状と課題」
大庫 直樹 氏(ルートエフ株式会社代表取締役、金融庁参与)

17:40~18:25 「日本の進化対応能力強化の戦略」
刈屋 武昭 氏(明治大学大学院グローバルビジネス研究科教授)

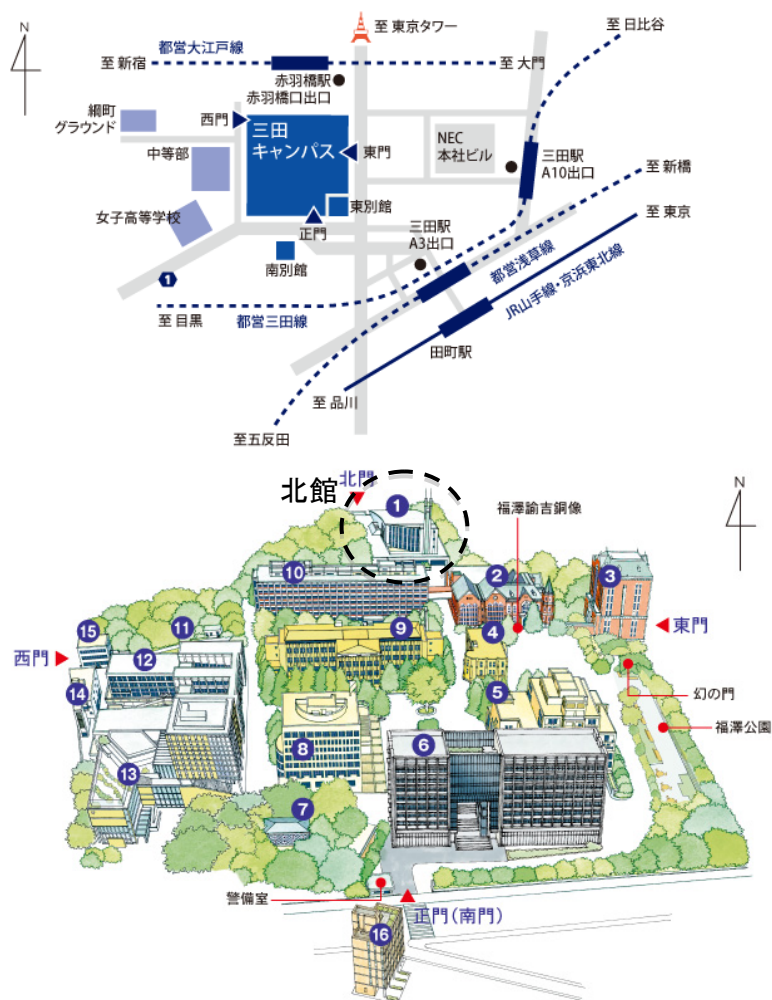
※記念シンポジウムのスケジュールなど詳細についてはJAFEEホームページ(<http://www.jafee.gr.jp/>)をご覧ください。

18:30-20:30 懇親会(会場:ファカルティクラブ (北館1階))

会場案内

慶應義塾大学 三田キャンパス 北館・ホール／大会議室

東京都港区三田2-15-45



- JR 山手線・京浜東北線／田町駅 徒歩8分
- 都営地下鉄 三田線・浅草線／三田駅 徒歩7分
- 都営地下鉄 大江戸線／赤羽橋駅 徒歩8分

2013年11月29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