

JAFEE

2014

夏季大会 プログラム

2014年8月1日(金)

2014年8月2日(土)

於：成城大学 3号館2階 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

2014年8月1日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付開始

10:00 -11:00 株価収益率分析 座長:山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

企業の資本構成が株式リターンに与える影響

河合 竜也(同志社大学大学院理工学研究科), 津田 博史(同左)

高谷 悠介(新生銀行)

Excess Comovement and Investor Attention in Japan

山本 零(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)), 徳永 俊史(武蔵大学経済学部)

11:15 -12:15 コモディティ・電力 座長:金村 宗(京都大学大学院総合生存学館)

一般化加法モデルを用いた JEPX 時間帯価格の予測手法

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系), 牧本 直樹(同左)

高嶋 隆太(東京理科大学理工学部)

Convenience Yield Revisited: Using Production Based Discrete-Time Model

中島 克志(立命館アジア太平洋大学国際経営学部)

12:15-13:15 昼休み、理事会・評議員会(於:32A教室)

13:15-13:45 総会

14:00 -14:45 JAFEE会長講演 司会:中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

『サイバーフィジカル融合社会における Web データの金融分野への応用可能性

～ホテルの稼働率推定とその応用～』

津田 博史(同志社大学理工学部数理システム学科)

15:00 -16:00 信用リスク1 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

小規模企業向け信用スコアリングモデルにおける業歴の頑健性と経営者の個人資産との関係性

尾木 研三(日本政策金融公庫、慶應義塾大学), 戸城 正浩(日本政策金融公庫)

枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

日本株式市場における倒産予測モデルの比較分析

北島 孝博(大阪市立大学大学院経営学研究科)

16:15 -17:45 リスク管理 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

誤方向リスク管理と資産価格変動の関係について

安達 哲也(日本銀行金融研究所), 内田 善彦(同左)

Analysis of Japanese Contractor's Activity According to Panel Data

紺野 由希子(横浜国立大学大学院国際社会科学研究所)

統合的なストレステストを実施するための、マクロストレスシナリオの生成手法の研究

西家 宏典(NTTデータ・フィナンシャル・ソリューションズ)

18:00-20:00 懇親会(於:7号館地下・SEIJO LOUNGE)

2014年8月2日(土)

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 派生証券価格評価 座長:新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

A Macro Economic Approach to Option Pricing

Hyeri Yu(立命館大学大学院理工学研究科), 赤堀 次郎(立命館大学理工学部)

Luca Taschini(London School of Economics)

担保契約を考慮に入れた派生証券に対する均衡価格アプローチ

瀧野 一洋(名古屋商科大学)

10:45 -12:15 市場モデリング 座長:山田 隆志(東京工業大学大学院総合理工学研究科)

マルチフラクタル・ブラウン運動モデルによる新たな市場変動予測モデルの提案

峰村 英二(住宅金融支援機構)

オプション市場の人工市場モデルによるオプション取引の原資産市場への影響分析

川久保 佐記(東京大学大学院工学系研究科)

和泉 潔(東京大学大学院工学系研究科、CREST、JST)

How Dynamic Networking Drives Stock Market Volatility and its Implications

Hongwei Chuang(Graduate School of Economics and Management, Tohoku University)

12:15-13:15 昼休み

13:15 -14:15 ポートフォリオ・マネジメント1 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

相似拡大的頑健効用と2ファクター金利モデルに基づく生命保険の多期間最適運用問題に対する近似解析解

楠田 浩二(滋賀大学経済学部)

サンプリングエラー存在下でのロバストポートフォリオ最適化(半正定値計画問題による固有値の推定誤差を用いた分散共分散行列の補正法)

南 聖治(りそな銀行)

14:30 -15:30 ポートフォリオ・マネジメント2 座長:磯貝 明文(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

ファンドマネジャーの気合いは有効か? アクティブ・ウェイトの説明力

小松原 宰明(イボットソン・アソシエイツ・ジャパン), 朱 永洙(同左)

Factor Based Tail Risk Parity/Budgeting Investment

中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

15:45 -16:45 信用リスク2 座長:中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Gamma 回帰によるデフォルト債権の回収額推計モデルの実証研究

今井 健太郎(日本リスク・データ・バンク), 尾藤 剛(同左)

Particle Learning を用いた CDS スプレッド分析

鶴田 大(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

17:00 -18:00 金利期間構造 座長:高見澤 秀幸(一橋大学大学院商学研究科)

低金利環境下における、金利連動型キャッシュバランス年金債務の市場整合的評価について

杉田 健(三井住友信託銀行)

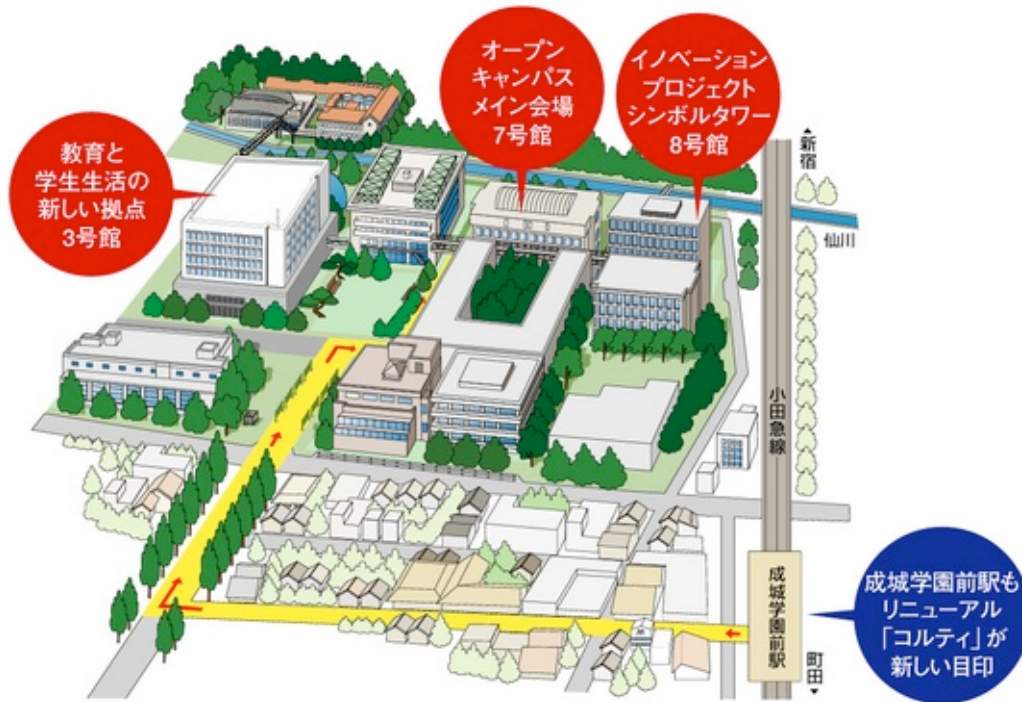
Nelson-Siegel Type Models with Regime Switches: Is the Deterministic Adjustment Term in the Arbitrage-Free Models Important?

Sim Dara(大阪大学大学院経済学研究科), 大西 匡光(同左)

会場案内

成城大学 3号館2階 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

2014年6月10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