

JAFEE

2016

夏季大会 プログラム

2016年8月8日(月)

2016年8月9日(火)

於：成城大学 3号館2階 322教室

主催：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

2016年8月8日(月)

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 ポートフォリオ・マネジメント 座長:山本 零(武蔵大学経済学部)

ランダム行列の漸近固有値分布を用いた平均分散モデルの投資リスクの理論評価
新里 隆(一橋大学森有礼高等教育国際流動化センター)

Dynamic Trading of Cointegrated Assets: Partial Information, Model Uncertainty Cases
中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

10:45 -12:15 統計的方法 座長:佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)

Dynamic Principal Component Analysis by the Malliavin-Mancino Method: Remarks on
Practical Implementations
劉 念麟(立命館大学BKC社系研究機構)

Stochastic Volatility Models with Stochastic Skewness and Kurtosis
野澤 勇樹(一橋大学大学院国際企業戦略研究科), 中村 信弘(同左)

CoVaRによるシステミック・リスク計測 ～確率的コピュラによる比較分析～
監物 輝夫(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

12:15-13:30 昼休み

13:30 -14:30 信用リスク 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

一般化線形混合モデルによる格付推移モデルのバイズ推定 ～日本の格付推移データによる実証分析～
田中 翔平(格付投資情報センター), 中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

A Macro-Financial Analysis of the Term Structure of Credit Spreads in Japanese
Corporate Bond Market
小林 武(名古屋商科大学経済学部)

14:45 -16:15 国際特別セッション1 司会:赤堀 次郎(立命館大学理工学部)

Endogenous Credit Constraints and Household Portfolio Choices
Hyung Keun Koo (Department of Financial Engineering, Ajou University)

An Optimal Consumption and Investment Problem with Quadratic Utility and Subsistence
Consumption Constraints: A Dynamic Programming Approach
Kum-Hwan Roh (Department of Mathematics, Hannam University)

Consumption and Portfolio Selection in the Presence of a Luxury Good
Yong Hyun Shin (Department of Mathematics, Sookmyung Women's University)

16:30 -17:30 国際特別セッション2 司会:塚原 英敦(成城大学経済学部)

Modelling Spreads
Andrea Macrina (Department of Mathematics, University College London)

Capital Allocation Methods in Risk and Insurance via Sequential Monte Carlo Samplers
Gareth Peters (Department of Statistical Science, University College London)

17:45-19:45 懇親会(於:7号館地下・SEIJO LOUNGE)

2016年8月9日(火)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

8:30 大会受付開始

9:00 -10:30 派生証券価格評価1 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

Local Risk Minimization and Delta Hedging Strategy for Exponential L'evy Models

今井 悠人(早稲田大学基幹理工学部), 新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

マイナス金利を考慮したフォワードレートモデルと市場の金利見通し

山田 哲也(日本銀行金融研究所), 菅沼 健司(同左)

パス空間における部分積分公式を用いたバリア・オプションの Greeks の解析的評価方法

石谷 謙介(首都大学東京大学院理工学研究科)

10:45 -11:45 派生証券価格評価2 座長:新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

The Value of Timing Risk

赤堀 次郎(立命館大学理工学部), 今村 悠里(東京理科大学経営学部),

Flavia Barsotti (UniCredit S.p.a.)

金融規制の複合的影響を考慮した XVA

斎藤 祐一(日本銀行金融研究所)

11:45-13:00 昼休み, 理事会・評議員会

13:00-13:30 総会

13:30 -15:00 金融特別セッション:「FinTechがもたらす新たな金融サービス」

司会:荒川 研一(りそな銀行 リスク統括部)

講演タイトル1:日本の金融機関にとってFinTechとは何か

岩下 直行(日本銀行 決済機構局 FinTechセンター長)

講演タイトル2:FinTech 意識調査から見えてくる金融機関の未来(仮題)

杉本 好正(NSフィナンシャルマネジメントコンサルティング 代表取締役社長)

15:15 -16:45 派生証券価格評価3 座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

Optimal Decomposition with Knockout Condition for Basket Barrier Options Using Additive Models

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

カウンターパーティリスク制約下での均衡プライシング

瀧野 一洋(名古屋商科大学商学部)

CVAにおける誤方向リスク・モデル:実装と比較

安達 哲也(金融庁), 末重 拓己(東京工業大学大学院総合理工学研究科),

吉羽 要直(日本銀行金融研究所)

17:00 -18:30 ファイナンシャル・リスク 座長:石島 博(中央大学大学院国際会計研究科)

企業の中期経営計画に関する特性及び株主価値との関連性について—中期経営計画データを用いた実証分析—

浅田 一成(三菱UFJ信託銀行), 山本 零(武蔵大学経済学部)

The Dynamics of Commodity Spot and Futures Prices under Production, Storage, and Financial Trading

中島 克志(立命館アジア太平洋大学国際経営学部)

ARCHモデルのミクロ的基礎付けの試み

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント)

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

2016年7月1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