

JAFEE

2020

冬季大会 プログラム

2021年2月21日(日)

Zoomによるオンライン開催

会場A : Meeting Room 1

会場B : Meeting Room 2

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

〒105-0004 東京都港区新橋6-7-9 新橋アイランドビル3階

公益総研株式会社 JAFEE担当

TEL 03-5405-1816 (事務センター代表)

FAX 03-5405-1814

Email office@jafee.gr.jp

2021年2月21日(日)

※報告時間:コンペティションは15分(質疑応答も含む)。一般発表は30分(質疑応答も含む)

※会場AはMeeting Room 1、会場BはMeeting Room 2 ※会議室IDとパスワードは別途通知します

9:00-10:30 (会場A) コンペティション I

座長: 安田 和弘(法政大学理工学部)

DCC CAW モデルとコンピュータによる VaR の予測
重本 秀人(関西学院大学大学院理工学研究科)

Nisio Semigroups on Graphs and their
Asymptotics in View of Applications to Finance
傍嶋 悠(立命館大学大学院理工学研究科)

Fractional Riccati Equation Related to Square
Integral of Fractional Brownian Motion.
土肥 健二(立命館大学大学院理工学研究科)

An Algebraic Approach to the Ramer-Kusuoka
Formula and its Applications
九保 佑匡(立命館大学大学院理工学研究科)

Higher Order Deep Solver of Non-Linear PDEs
Implied by a Non-Linear Discrete Clark-Ocone
Formula
古市 優衣(立命館大学大学院理工学研究科),
大熊 香里(QUICK)

A New Control Variate Method for Deep BSDE
Solver: Solving High-Dimensional Forward-
Backward Stochastic Differential Equations
土田 容史(一橋大学大学院経済学研究科),
高橋 明彦(東京大学大学院経済学研究科),
山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

10:50-12:05 (会場A) コンペティション II

座長: 小池 祐太(東京大学大学院数理学研究科)

複数資産間における相関構造の時間変動性と経済変数
との関連性に対する定量的分析
若月 哲郎(一橋大学大学院経営管理研究科)

国債イールドカーブ情報を用いた機械学習に基づく経
済予測モデルの構築
水門 善之(東京大学大学院工学系研究科),
和泉 潔(同上), 坂地 泰紀(同上), 島田 尚(同上)

POS データ分析に基づく企業業績予測と株式投資戦略
大城 真太郎(一橋大学大学院経営管理研究科),
横内 大介(同上)

マルチモーダル深層学習を用いたアナリストレポート
の極性値推定と株式市場への応用
林 大地(同志社大学大学院理工学研究科),
津田 博史(同上)

有価証券報告書のテキスト分析: 株式市場への反応評価
金野 有真(慶應義塾大学大学院経営管理研究科),
林 高樹(同上)

12:05-13:15 昼休み

9:00-10:30 (会場B) 金利リスクと価値尺度【一般発表】

座長: 中川 秀敏(一橋大学大学院経営管理研究科)

Systemic Interest Rate Risk Contributions:
A Structural Model Approach
桜井 悠司(リッチモンド連邦準備銀行)

※9:00-9:30

双鋭感的価値尺度(BSVM)とその応用
宮原 孝夫(名古屋市立大学名誉教授)

※9:30-10:00

IPDE-Based Bayesian Statistical Inference for
CIR Interest Rate Model with Poisson Jump
北林 卓也(三井住友DSアセットマネジメント),
中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

※10:00-10:30

10:50-11:50 (会場B) 派生商品【一般発表】

座長: 山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

2項分岐木を用いたオプション価格と感応度計算の新手
法: 離散 Carr and Madan 公式アプローチ
室井 芳史(東北大学大学院経済学研究科),
佐伯 遼太(第一生命保険),
須田 真太郎(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

※10:50-11:20

Quantum Pricing with a Smile: Implementation of
Local Volatility Model on Quantum Computer
宮本 幸一(大阪大学 量子情報・量子生命研究センター、
みずほ第一フィナンシャルテクノロジー),
金子 和哉(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー),
武田 直幸(同上), 吉野 一慶(同上)

※11:20 -11:50

13:15-14:00 JAFEE会長講演 司会: 荒川 研一(りそな銀行)

『ファイナンスにおける接合関数』

塚原 英敦(成城大学経済学部)

14:15-15:45 (会場A) 信用リスク【一般発表】

座長: 大本 隆(野村アセットマネジメント)

信用リスクの異なる CDS を活用した米国社債の投資戦略の構築と分析

城川 寛明(アセットマネジメントOne、一橋大学大学院経営管理研究科)

半正定値制約を用いた判別曲面と離散変数を用いた変数選択を同時に表現する信用リスク定量化モデルの提案と評価

田中 克弘(慶應義塾大学大学院理工学研究科)

銀行口座の入出金情報に基づく個人の行動特性を考慮したカードローンの途上管理に関するモデル構築

上武 治紀(りそな銀行),
枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

14:15-15:45 (会場B) 株式市場【一般発表】

座長: 佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)

ポジティブサプライズが自社株買いアノマリーに及ぼす影響に関する研究

立中 駿太(慶應義塾大学大学院理工学研究科),
枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

日本市場の効率性の時間変動: マルチフラクタル解析によるアプローチ

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

Winners and Losers in DOW 30 Stocks by the Performance Indexes Incorporating High Moments and Disaster Risk

程島 次郎(名古屋商科大学経済学部),
山分 俊幸(同上)

16:00-17:30 (会場A) 機械学習と市場分析【一般発表】

座長: 足立 高德(東京都立大学大学院経営学研究科)

人工知能は相場操縦という不正な取引を勝手に行うか? - 遺伝的アルゴリズムが人工市場シミュレーションで学習する場合 -

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント)

Investment Strategies Using Polarity of News in Japanese Stock and USDJPY Exchange Markets

今井 勇輝(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー),
柴田 大輝(同上), 佐々木 洋(同上)

ウェブレット法による株式市場における多重先行遅行関係に関する実証分析

林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科),
小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

16:00-17:30 (会場B) ポートフォリオ問題【一般発表】

座長: 山本 零(慶應義塾大学理工学部)

ライフサイクルにおける動的ポートフォリオ選択問題: 外国投資とフォワードバイアスを用いた為替ヘッジ

鈴木 誠(京都大学大学院経営管理教育部),
内山 朋規(東京都立大学大学院経営学研究科)

平均・分散アプローチによるインプライド分布を用いた最適通貨ポートフォリオ

枇々木 裕太(慶應義塾大学大学院理工学研究科),
霧生 拓也(慶應義塾大学大学院理工学研究科、MTEC),
枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

実現半分散を用いた資産配分問題

山本 健弘(慶應義塾大学大学院理工学研究科),
枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

17:30-17:45 (会場A: Meeting Room 1) コンペティション表彰式

Zoomによるオンライン開催

会場A : Meeting Room 1

会場B : Meeting Room 2

※会議室IDとパスワードは別途通知します

2021年1月13日発行

発行 日本金融・証券計量・工学学会 (**JAFEE**)

制作 〒105-0004 東京都港区新橋6-7-9

新橋アイランドビル3階

公益総研株式会社 JAFEE担当

TEL 03-5405-1816(事務センター代表)

FAX 03-5405-1814

Email office@jafee.gr.jp