

# JAFEE

## 2024

### 夏季大会 プログラム

2024年8月17日(土)

於：一橋大学 国立 西キャンパス 本館21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

〒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

2024年8月17日(土)  
報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付開始

9:30-11:00 金融資本市場 座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

多国間時変動テイラー・ルール：非伝統的金融政策のモデル化とグローバル・リスク・プレミアとしての活用

森田 徹(日興アセットマネジメント、東京大学大学院経済学研究科)

ESG CAPM と ESG ファクターモデルの理論に関するノート

石島 博(中央大学大学院法務研究科),

前田 章(東京大学大学院総合文化研究科)

グローバル金利市場の連動性を踏まえた機械学習に基づく円金利予測モデルの構築

水門 善之(野村証券金融経済研究所、東京大学大学院工学系研究科)

11:20-12:20 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))

Post-Last Exit Time Process and its Application to Loss-Given-Default Distribution

Masahiko Egami (京都大学大学院経済学研究科),

Rusudan Kevkhisvili (同上)

Decomposing the Term Structure of Credit Spreads and Predicting the Macroeconomy in Japan

小林 武(名古屋商科大学ビジネススクール)

12:20-14:00 昼休み・代議員会

(代議員会は、本館31室とZoom会議室のハイブリッド開催です。

Zoom会議室のIDとパスワードは代議員宛に別途通知します)

14:00-15:00 KAFE-JAFEE Joint Session 座長: Rusudan Kevkhisvili (Graduate School of Economics, Kyoto University)

Machine Learning Applications In Classical Financial Economics

Doojin Ryu (Sungkyunkwan University)

Gerber-Shiu Analysis: Default-related Quantities under Levy Risk Processes

Yasutaka Shimizu (Waseda University)

<次ページに続く>

**15:20-16:20 金融時系列データ 座長:佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)**

Empirical Study of Portfolio Performance Using High-Frequency Data: A Liquidity Perspective

Zheng Xuzhu (大阪大学大学院経済学研究科)

ボラティリティ時系列のハースト指数測定におけるマイクロストラクチャーノイズと有限サンプル数効果

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

**16:40-18:10 数理モデル 座長:安田 和弘(法政大学理工学部)**

Learning Parameter Dependence for Fourier-based Option Pricing with Tensor Networks

櫻井 理人(東京大学大学院理学系研究科),

高橋 治利(埼玉大学理学部),

宮本 幸一(大阪大学量子情報・量子生命研究センター)

平均場ゲーム理論を用いた資産価格形成モデル

藤井 優成(東京大学大学院経済学研究科),

関根 雅(同上)

Higher-Order Moment Risk Premiums: The Impact of Stochastic Variances and Self-Exciting Jumps

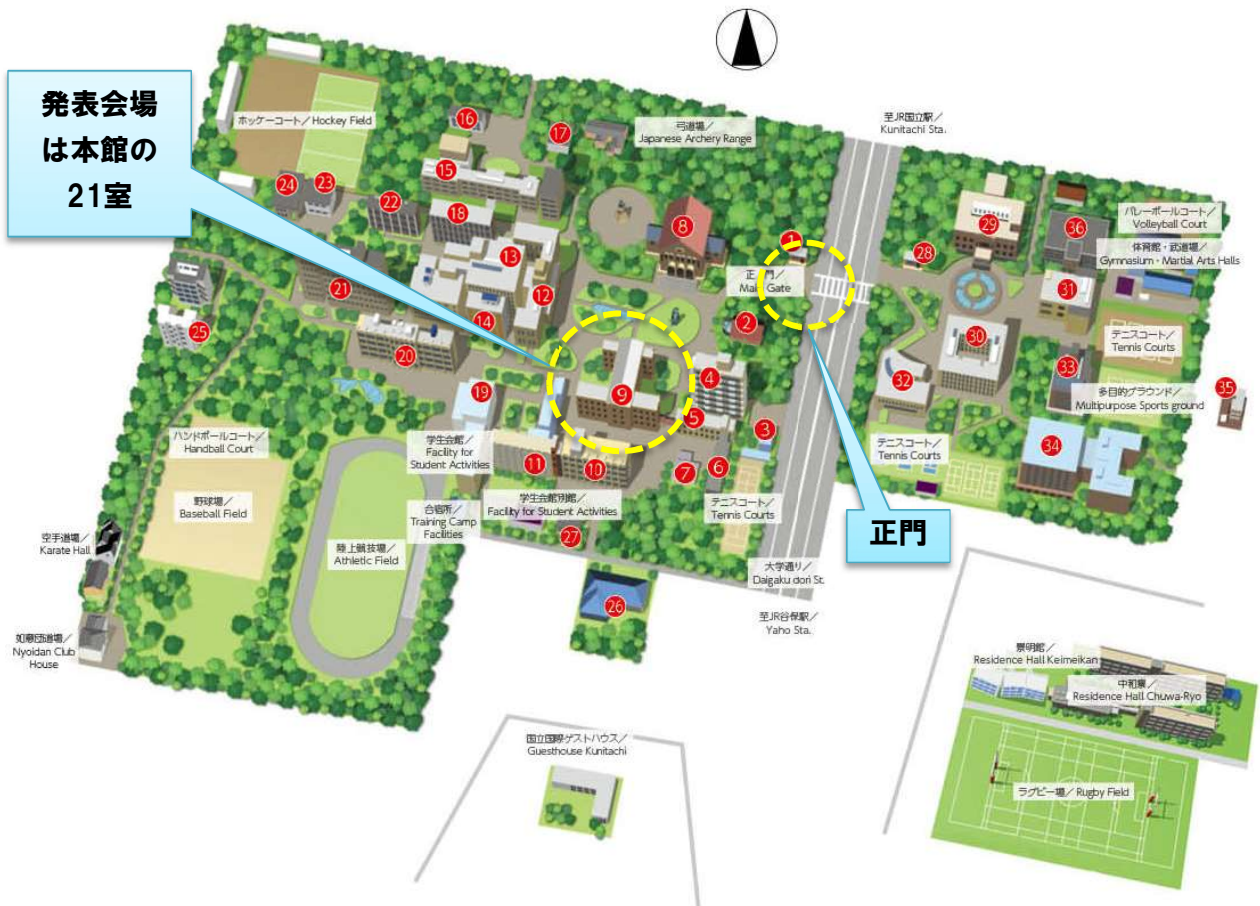
中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

# 会場案内

一橋大学 国立 西キャンパス 本館21室

東京都国立市中2-1

JR中央線・国立駅 正門まで徒歩約10分



2024年7月8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