

JAFEE

1999

冬季大会 プログラム

12月17日(金)

12月18日(土)

於：東京大学・大学院数理科学研究科（駒場キャンパス）

目黒区駒場3 - 8 - 1

日本金融・証券計量・工学学会

(The Japanese Association of Financial Econometrics and Engineering)

事務局

〒980 - 8576 仙台市青葉区川内

東北大学 大学院経済学研究科 佃良彦研究室

Tel. 022-217-6302 / Fax. 022-217-6327

12月17日(金)

報告時間は20分 [は30分] (質疑応答も含む)

9:00	大会受付		
9:40-10:20	銀行評価	座長：枇々木 規雄(慶應義塾大学)	
	DEA で分析した巨大提携も含む銀行の効率性について		
	高橋 智彦(日本生命、筑波大学)		1
	主成分分析を利用した次元縮小によるリスクコントロールについての一考察()		
	西山 昇(朝日ライフ アセットマネジメント(株)、東京工業大学)		11
10:30-12:00	資産運用	座長：葛山 康典(早稲田大学)	
	Utilization of Neural Networks & GAs for Constructing Reliable Decision Support Systems to Deal Stocks		
	馬場 則夫(大阪教育大学)、井上 直行(大阪教育大学)、浅川 寛之(大阪教育大学)		21
	予測と運用成果		
	北村 智紀(太陽投信委託)		29
	戦略的資産配分問題に対する多期間確率計画モデル		
	枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)		36
12:00-13:40	昼休み, 理事会・評議員会		
13:40-14:40	チュートリアル	座長：鈴木 賢一(東北大学)	
	「金融工学と数理計画法」		
	田辺隆人(数理システム)		56
14:50-15:40	総会		
15:50-17:20	信用リスク	座長：白川 浩(東京工業大学)	
	ポートフォリオ制御アプローチによる信用リスク制御手法の検討		
	久保 理(日立製作所)、横田 毅(日立製作所)、小林 康弘(日立製作所)		66
	ダウングレード・プロテクションの評価モデル		
	青沼 君明(東京三菱銀行、東京大学)		73
	A Markov Chain Model with Stochastic Default Rate for Valuation of Credit Spreads		
	小寺 英司(東洋信託銀行)		93
	K-th to Default Swaps		
	高田 勝己(さくら銀行)		108
18:00-20:00	懇親会(駒場エミナース)		

12月18日(土)

報告時間は20分 [は30分] (質疑応答も含む)

9:30	大会受付		
10:00-11:20	金融市場取引	座長：小暮 厚之(千葉大学)	
	短期金融市場における金利裁定 日本銀行の金融政策波及経路の再検討 TEE KIAN HENG(広島大学)、鄭 燕(広島大学)		109
	The Effect of Losing Homogeneity to the Yield Curve 山田 雅章(東海インターナショナル証券)		127
	VWAP 取引の分割発注 小西 秀(東京三菱証券エクイティ部)		134
	深刻な非同時取引下における回帰モデルのベイズ分析 高山 俊則(エスジー山一アセットマネジメント)		150
11:30-12:30	オプション価格付け	座長：青沼 君明(東京三菱銀行)	
	Computer Simulation of [Geometric Levy Process & MEMM] Pricing Model 肖 凱(名古屋市立大学)、宮原 孝夫(名古屋市立大学)、三澤 哲也(名古屋市立大学)		153
	一般化2項モデルとその確率測度 宮下 景樹(法政大学)、山本 将紀(法政大学)、浦谷 規(法政大学)		163
	HJM モデルにおける短期金利プロセス 大石 良則(法政大学)、浦谷 規(法政大学)		177
12:30-13:30	昼休み		
13:30-14:30	会長講演	司会：森平 爽一郎(慶應義塾大学)	
	「Modelling the Stock Returns and Trading Volumes」 佃 良彦(東北大学)		184
14:40-15:30	アセット・プライシング	座長：津田 博史(ニッセイ基礎研究所)	
	Crazy Explanations for the Performance of the Consumption CAPM with Japanese Data 祝迫 得夫(筑波大学社会工学系)		185
	Data-Snooping Biases in Tests of Financial Asset Pricing Models: A Japanese Case Jiro HODOSHIMA(名古屋市立大学経済学部)、高橋 智明(住友銀行市場管理部)		205
15:40-16:20	金融技術の新展開	座長：三浦 良造(一橋大学)	
	新リバース・モーゲージの評価モデル 青沼 君明(東京三菱銀行、東京大学)、村内 佳子(東京三菱銀行、筑波大学)		216
	気温デリバティブズの評価と企業財務ヘッジ効果 佐藤 賢一(慶應義塾大学 政策・メディア研究科)、森平 爽一郎(総合政策学部)		231