

JAFEE

2001

冬季大会 プログラム

12月14日(金)

12月15日(土)

於：学習院大学 百周年記念会館

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 三浦良造研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

12月14日(金)

報告時間 無印20分 印30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

9:30 -10:50 信用リスクモデル (座長：山内 浩嗣 MTEC)

Default risk in Project financing for dual scheduled amortization

浦谷 規 (法政大学工学部)、宇都宮 誠 (東京三菱銀行)

相関を考慮したファーストデフォルト時刻

高田 英行 (興銀第一ファイナンシャルテクノロジー)

Extended Merton Model And Its Applications

中村 信弘 (一橋大学大学院)

11:00 -11:30 信用リスクの推定 (座長：青沼 君明 東京三菱銀行)

格付推移確率行列の期間構造モデル 多状態、競合リスク、時間依存変数を考慮した生存時間分析による

森 正貴, 森平 爽一郎 (慶應義塾大学),

小島 将信, 木村 公平, 岩淵 勝茂 (帝国データバンク)

11:30-13:00 昼休み, 理事会・評議員会

13:00 -14:00 会長講演「計測モデルに関する2, 3の話題」

三浦 良造 会長 (一橋大学大学院)

14:00 -15:30 特別セッション 司会 大上 慎吾 (一橋大学大学院)

Dynamic Markowitz problems with no bankruptcy

Professor Stanley Pliska (University of Illinois at Chicago)

15:30 -16:30 最適化と制御, OR (座長：枇々木 規雄 慶應義塾大学)

最適ポートフォリオ決定問題向け主双対内点法の開発

川本 茂, 高元 政典, 小林 康弘(日立製作所)

需要・供給モデルにおける市場価格のモデリングと制御

三浦 貴治, 大森 浩充, 佐野 昭 (慶應義塾大学大学院)

16:40 -17:30 Hedging strategy (座長：池田 昌幸 青山学院大学)

On super hedging under delta constraints

関根 順 (大阪大学)

Mean-variance hedging for semi martingale with independent increments

新井 拓児 (筑波大学大学院)

17:50-19:50 懇親会

12月15日(土)

報告時間 無印20分 印30分(質疑応答も含む)

8:30 大会受付

9:00 -10:40 時系列分析 (座長：庄司 功 筑波大学社会工学系)

トレンドがある下での株価変化と売買高との関係

鈴木 喜久, 得津 康義 (広島大学)

Identification Of Time Series Financial Data using BP Neural Networks

高 大勇, 木内 陽介, 伊藤 国彦(徳島大学)

ティックサイズと市場の流動性について

渡部 肇 (日経QUICK情報)

為替市場におけるボラティリティ予測

中窪 文男 (ニッセイ基礎研究所)

10:50 -11:30 証券化 (座長：森平 爽一郎 慶應義塾大学)

住宅ローンのプリペイメント・デフォルト競合リスクのモデル化と実証分析

杉村 徹 (あさひ銀行, 一橋大学大学院)

Estimating the hazard function using local partial likelihood.

大上 慎吾 (一橋大学大学院)

11:30 -12:30 Option評価, 格子モデル (座長：大森 敬治 三和銀行)

拡張2項モデルによるリアルオプション評価

高見 茂雄 (東京工業大学)

LIBOR マーケットモデルにおける再結合格子の作成方法について

船山 幸一郎 (東京三菱銀行)

アメリカンオプションの明示的価格式

渡辺 弘之 (イーオス)

12:30-13:30 昼休み

13:30 -15:00 特別講演 金融時系列解析への確率微分方程式の利用：為替Daily Marketのモデリング

尾崎 統 (統計数理研究所)

15:10 -16:40 Mathematical corporate, continuous-time finance (座長：藤田 岳彦 一橋大学大学院)

ストック・オプション発行企業の財務構造の数理モデル化

石井昌宏 (電気通信大学)

Dynamic minimization of the worst conditional expectation of shortfall under partial information

関根 順 (大阪大学)

取引コストのある市場における効用最大化問題について

神園 健次 (長崎大学)

16:50 -17:50 Exotics, Option評価 (座長：塚原 英敦 成城大学)

On the Pricing of α -percentile barrier options

藤田 岳彦 (一橋大学大学院), 三浦 良造 (一橋大学大学院)

Two Factor Forward Risk Adjusted Measure and the Pricing Derivatives

岳進(一橋大学大学院), 高橋一(一橋大学大学院)