

JAFEE

2002

12 20

12 21

於：慶應義塾大学 三田キャンパス北館ホール

日本金融・証券計量・工学学会

(The Japanese Association of Financial Econometrics and Engineering)

101-8439

2-1-2

8F

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

12月20日(金)

報告時間 無印20分 印30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:30 -10:20 倒産確率の推定

水野 伸昭 (東海東京証券)

Estimation of Failure Probability using Semi-Definite Logit Model

川代 尚哉 (東京工業大学大学院), 今野 浩 (中央大学)

10:30 -11:40 確率過程の推定問題

Filtering of Stochastic Volatility

相原 伸一 (諏訪東京理科大学), Arunabha Bagchi (Twente University)

Estimation of Stochastic Volatility Models : A Laplace Approximation Approach to the Kalman Filter

島田 淳二 (東北大学), 佃 良彦 (東北大学)

A Note on Yu-Phillips' Estimation for a Continuous Time Model of a Diffusion Process

河合 研一 (広島大学大学院), 前川 功一 (広島大学)

11:40-12:40 昼休み, 理事会・評議員会

12:40 -14:20 最適化問題

Portfolio Optimization under Short Sale Opportunity

越塚 知幸 (中央大学大学院)

澤木 勝茂 (南山大学)

Optimal Dividend Policy with Transaction Costs under a Brownian Cash Reserve

大西 匡光 (大阪大学), 辻村 元男 (大阪大学)

Optimal Investment Strategies with VaR and Upside-Chance Constraints in the Stochastic Interest Rate Economy

中村 信弘 (一橋大学大学院)

14:30 -15:50 最適化問題

CBO Pool

佐藤 賢一 (エムティーピー インベストメント テクノロジー研究所)

Exponential hedging, power-utility maximization, and quadratic BSDEs

関根 順 (大阪大学大学院)

Jump diffusion process

柏原 聡 (一橋大学大学院)

16:00 -17:20 数値的方法

Historical Simulation

中村 孝志 (東京三菱銀行)

今井 潤一 (岩手県立大学)

欠損値の対処法について

金子 拓也 (あさひ銀行), 二宮 祥一 (東京工業大学)

18:00-20:00 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)

9:00 大会受付

9:30 -10:50 オプションとその応用

磯部 直也

磯部 直也

An Application of New Barrier Options (Edokko Options) for Pricing Bonds with Credit Risk
藤田 岳彦(一橋大学大学院), 石坂 元一 (一橋大学大学院)

11:10 -12:10 金融商品の評価モデル

CDO

鍛冶 俊輔 (MTBインベストメントテクノロジー研究所)

青沼 君明(東京三菱銀行), 中山 季之(東京三菱銀行), 村内 佳子(東京三菱銀行)

不動産価格指数の先物とオプション: その評価とヘッジング
森平 爽一郎 (慶應義塾大学)

12:10-13:10 昼休み

13:10-14:00 日本の証券市場

遠藤 操 (筑波大学), 岸本 一男 (筑波大学)

1990

祝迫 得夫 (一橋大学)

14:10 -15:20 Financial Boltzmann Model

Financial Boltzmann Model Application to Multi Assets Problems
植之原 雄二 (東芝)

Financial Boltzmann Model Application to Power Market
村上 好樹 (東芝)

Financial Boltzmann Model Application to Non-Life Insurance Portfolio
竹澤 伸久 (東芝), 植之原 雄二 (東芝)

15:30 -16:40 リアルオプション

山田 雅章 (UFJつばさ証券)

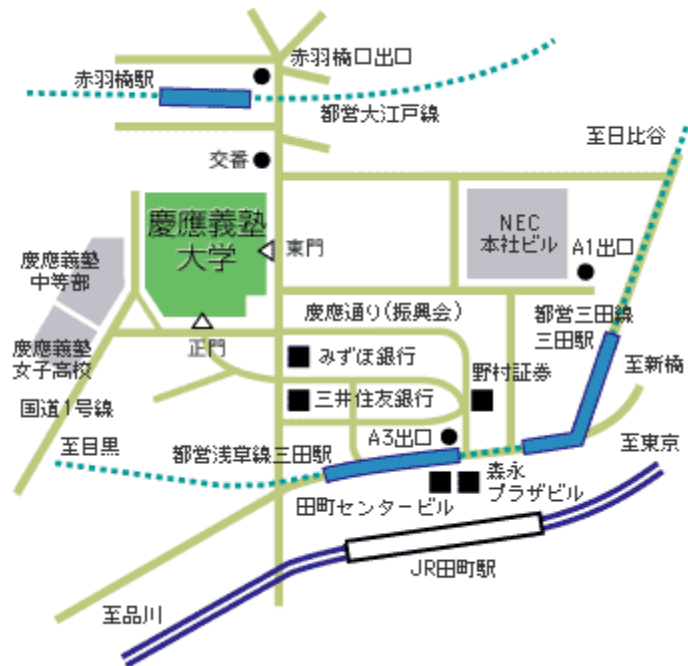
辺見 和晃 (構造計画研究所)

池田 裕一 (日立製作所)

〒108-8345 東京都港区三田2-15-45 Tel. 03-3453-4511(代)

<http://www.keio.ac.jp/access.html>

- JR山手線，京浜東北線 田町駅下車(徒歩8分)
- 都営地下鉄浅草線，都営地下鉄三田線 三田駅下車(徒歩7分)
- 都営地下鉄大江戸線 赤羽橋駅下車(徒歩8分)



2001年10月30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

三浦良造研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当