

7月25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 -10:30 金融ポルトマンモデル

金融ポルトマンモデル その解法(グリーン関数モンテカルロ) -
植之原 雄二 (東芝), 竹澤 伸久 (東芝)

金融ポルトマンモデルの再保険への適用
竹澤 伸久 (東芝), 植之原 雄二 (東芝)

電力フォワード・カーブと電力価格変動モデル 従来モデルおよび金融ポルトマン・モデル
村上 好樹 (東芝), 竹澤 伸久 (東芝), 植之原 雄二 (東芝),
加名生 雄一 (東芝), 立見 高浩 (東芝ロジスティックス・ソリューションズ)

10:40 -12:20 数理ファイナンス

Indeterminacy of Equilibrium Price of Money, Market Price of Risk and Interest Rates
田中 敬一 (大阪大学大学院)

Mean-Variance Hedging for General Semimartingales
新井 拓児

Calibration Problem of [GLP & MEMM] Pricing Model
宮原 孝夫

Term Structure Model of Inflation and Pricing TIPS in the Incomplete Market
中村 信弘 (一橋大学大学院)

非完備情報リアル・オプションにおける企業プロジェクト価値の分解された不確実性に対する比較静学
芝田 隆志 (京都大学大学院)

12:20-13:20 昼休み, 理事会・評議員会

13:10 -14:50 「金融商品」特別セッション

日本における ABS 市場について
羽仁 千夏 (メリルリンチ日本証券)

日本におけるクレジットデリバティブ市場について
糸田 真吾 (UBS証券会社)

リアルオプションによる企業評価について
山口 浩(国際金融情報センター)

14:50-15:20 総会

15:20 -16:20 デフォルト・リスク

フェイディング・アウト・スワップの評価モデル
青沼 君明 (三菱証券), 中山 季之 (三菱証券株式会社)

非補償型ロジックモデルを用いたデフォルト確率予測モデルの改善提案
坂巻 英一 (金融工学研究所 / 東京工業大学)

マートン・モデルとロングスタッフ・シュワルツ・モデルの比較分析
水野 伸昭 (東海東京証券)

16:30 -17:20 リスク管理

構造型アプローチと誘導型アプローチを融合させた住宅ローンの期限前償還率モデルに関する研究
一條 裕彦 (りそなホールディングス)

統合的なリスク指標とキャピタル配分ルール
王 京穂 (NTTデータ)

預貸尻 VaR を用いた銀行勘定の流動性リスク管理手法
中村 孝志 (東京三菱銀行総合リスク管理室)

17:40-19:40 懇親会

7月26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 金融工学と統計的方法

金融工学基礎理論と既存理論の基礎的差異
磯部 直也

Iterative Formula for Exponentially Weighted Rolling Regression
金谷 太郎 (京都大学)

トレーディング・ルールの周波数応答特性
飯野 光徳 (みずほ信託銀行)

VaR is subject to a significant positive bias
乾 孝治 (京都大学), 木島 正明 (京都大学), 北野 淳史 (金融庁)

11:00 -12:20 実証分析

日本株式市場における不振企業ファクターの有無
佐藤 歩 (早稲田大大学院)

How did Japanese investments influence international art prices?
平木 多賀人 (国際大学), 伊藤 彰敏 (国際大学), 竹澤 直哉 (国際大学)

エマージング株式市場における平均-分散分析の拡張が投資政策に与える影響について
渡辺 泰明 (愛知淑徳大学)

気温TTリスクスワップの等価性の検証
刈屋 武昭 (京都大学), 牛山 史朗 (京都大学情報学研究科), 遠藤 良輔 (京都大学)

12:20-13:20 昼休み

13:20-14:50 「日本不動産金融工学学会」特別セッション

不動産金融工学の展望
刈屋 武昭 (京都大学)

不動産におけるデフォルトリスクモデリング
森平 爽一郎 (慶應義塾大学)

金融工学からみた不動産の特徴 ジャフレと ARES 等の活動の紹介
川口 有一郎 (明海大学)

15:00 -15:40 トレーディング・システム

マネージャーラッピング
菅野 泰夫 (大和総合研究所), 玉之内 直 (大和総合研究所), 佐藤 弘明 (大和総合研究所)

ソフトコンピューティング技術を活用した知的株式売買意思決定支援システムの構築
馬場 則夫 (大阪教育大学), Wang Yaai (大阪教育大学), 川地 智子 (大阪教育大学)

15:50 -17:10 プライシング

有限要素法による Option Pricing
高橋 茂 (三菱総合研究所)

天候デリバティブ：インデックスの分布とプライシング
王 京穂 (NTTデータ), 遠藤 直子 (みずほ第一フィナンシャルテクノロジー)

無裁定市場における生命保険および生命再保険のプライシング
小島 茂 (千葉大学大学院)

イベントリスクに関するオプション価格決定モデルとその応用
森平 爽一郎 (慶應義塾大学)