

8月4日(水)

報告時間 無印20分 印30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00-11:10

セッションA 不完備市場

Smile/skew 現象を構造的に有している証券市場モデルとしての幾何レヴィ過程モデルについての考察
森脇 成彦(名古屋市立大学大学院)

Esscher 変換による同値マルチンゲール測度の比較
宮原 孝夫(名古屋市立大学大学院)

Stock Repurchase Policy with Transaction Costs under Jump Risks
辻村 元男(京都大学大学院), 郷古 浩道(京都大学), 大西 匡光(大阪大学・京都大学)

セッションB 計算ファイナンス

事業プロジェクト現在価値の分散・共分散評価法
伊藤 保之(東芝)

ランダム化した低食い違い量列に潜在する特性がデリバティブ評価に与える影響
田村 勉(格付投資情報センター・東京工業大学大学院)

確率ボラティリティモデルを用いた平均/分散ヘッジ戦略の計算
関根 順(大阪大学大学院)

11:20 -12:20

セッションA 統計的方法

ニューロ判別モデルとリサンプリング法
辻谷 将明(大阪電気通信大学)

The effect of nonnormality on the inference of expected asset returns in asset pricing models
程島 次郎(名古屋市立大学大学院)

レンジ及び日中データを使用した為替レートのボラティリティ予測
中窪 文男(ニッセイ基礎研究所), 森棟 公夫(京都大学大学院)

セッションB 計算結果報告セッション

12:20-13:20 昼休み, 理事会・評議員会

13:20-14:50 金融商品特別セッション

15:00-15:30 総会

15:40 -17:20 クレジットリスク

多目的遺伝的アルゴリズムを用いた財務スコアリングモデルのチューニング
山内 浩嗣(MTEC・東京工業大学)

財務データを利用した Structural 型倒産確率算出モデルの研究
金子 拓也(東京工業大学大学院・りそな銀行), 中川 秀敏(東京工業大学)

デュレーション-クレジットクオリティに基づく社債イールドスプレッド面のダイナミクスの分析
正田 智昭(MTEC・一橋大学大学院)

格付けと社債スプレッドを用いた MCMC による信用スコアとその確率過程の推定
佐藤 秀晶(みずほ信託銀行)

17:45-19:45 懇親会

8月5日(木)

報告時間 無印20分 印30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00 -10:50 価格付け1

マルチファクター・ガウシアン・モデルによる物価連動国債の価格付け
二見 英徳(一橋大学大学院・東京海上火災保険)

Pricing of Exotic Interest Rate Derivatives and its Calibration
丹波 靖博(大阪大学大学院)

11:00 -12:20 価格付け2

株価収益率のGH分布モデルによるオプション価格評価
朱涵明(広島大学大学院), 前川 功一(広島大学大学院)

小分散漸近展開によるクレジットバスケットスワップの評価法
室井 芳史(東京大学大学院)

契約者持分の増加と契約の転換を考慮した企業年金保険の価格付け
鈴木 輝好(北海道大学大学院)

12:30-13:30 昼休み

13:40 -14:50 最適化

負債を完全にヘッジできない場合の確定給付年金の動的最適ポートフォリオ
内山 朋規(野村證券)

Optimal Consumption and Portfolio Decisions in a Levy Economy: A Perturbative Approach
安達 哲也(日興コーディアル証券)

Explicit Solutions of Constrained Portfolio Optimization for a Linear Single Factor Model - Duality Approach -
中村 信弘(一橋大学大学院)

15:00 -16:20 実証分析1

危険回避度の推計：保険需要クロスセクションデータによる分析
森平 爽一郎(慶応義塾大学), 神谷信一(慶応義塾大学)

業界対比財務指標を使った倒産確率の推定
水野 伸昭(UFJ銀行)

気象条件が投資機会のレジームシフトに及ぼす影響の定量的分析
石島 博(慶應義塾大学大学院), 吉田 晴香(慶應義塾大学大学院)

16:30 -17:40 実証分析2

リターンリバーサル効果の真実：マーケットマイクロストラクチャーからの視点
諏訪部 貴嗣(ゴールドマン・サックス証券・総合研究大学院大学)

債券ポートフォリオの期待リターンの推計
小松原 宰明(イボットソン・アソシエイツ・ジャパン)

ショートターム・リスクモデル(JPE3S)の開発 日次ファクターリターンによる共分散行列の推定
鎌田 直人(バーラ・ジャパン)

会場案内

明治大学駿河台校舎

〒101-8301 東京都千代田区神田駿河台1-1

Meiji University Campus Guide

