

JAFEE

2008

夏季大会 プログラム

8月1日(金)

8月2日(土)

於：成城大学 3号館 321教室

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 金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

8月1日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付

9:30 -11:00 ポートフォリオ・マネジメント 座長:山本 零(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC) 研究部)

Improving the Out-of-Sample Performance via VaR/CVaR Minimization:

A Statistical Learning Approach to Portfolio Selection

後藤 順哉(中央大学 理工学部 経営システム工学科),

武田 朗子(慶応義塾大学 理工学部 管理工学科)

過小資本の下での最適アセットアロケーション

清水 康弘(野村証券)

相対価値トレードの最適投資戦略

村上 昭博(野村証券 金融工学研究センター)

11:10-12:10 会長講演 司会:塚原 英敦(成城大学 経済学部)

Volatility Models

森棟 公夫(京都大学大学院 経済学研究科)

12:10-13:10 昼休み

13:10 -14:40 金融商品特別セッション: セッションテーマ「サブプライム問題以降の新たな市場環境における展望」

司会:石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科)

講演1:「新たな環境下における年金資産運用の方向性の検討」

青柳 潔(JPモルガン・アセット・マネジメント 投資戦略ソリューション室 ヴァイスプレジデント)

講演2:「代替的投資:コモディティ、インフレ・リンク等」

大本 隆(野村証券 金融工学研究センター デリバティブプロダクトリサーチグループ 次長)

講演3:「リスク管理の動学化と市場参加者間の相互依存性」

副島 豊(日本銀行 金融研究所 企画役 ファイナンス研究担当総括)

15:00 -16:00 個別案件の信用リスク管理 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC) 研究部)

Failure Discrimination by Semi-Definite Programming Using Maximal Margin Hyperplane

岡田 洋平(りそな銀行 リスク統括部 金融テクノロジーグループ),

今野 浩(中央大学 理工学部 経営システム工学科)

一般化加法モデルによる個人ローンの生存データ解析

辻谷 将明(大阪電気通信大学 情報通信工学部),

Bart Baesens(University of Southampton)

16:10 -17:40 ポートフォリオの信用リスク管理 座長:青沼 君明(三菱東京UFJ銀行 融資企画部)

Recovery Process Model

伊藤 有希(一橋大学大学院 経済学研究科 博士課程)

CreditRisk+モデルの動的な振舞

小澤 栄作(一橋大学大学院 国際企業戦略科 博士後期課程)

連鎖倒産のシミュレーションに関する考察

~矢印 KeyGraph(データマイニング及びグラフ化手法)の展開

郷田 慎一(東京大学大学院 工学系研究科 システム創生学専攻 博士課程),

大澤 幸生(東京大学大学院 工学系研究科 システム創生学専攻)

8月2日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

10:00 -11:00 派生証券価格評価 座長:中川 秀敏(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

Variance Gamma モデルの下での周辺測度変換によるデリバティブ価値評価
川西 泰裕(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

Equilibrium Preference Free Pricing of Derivatives under the Generalized Beta Distributions

池田 昌幸(早稲田大学大学院 ファイナンス研究科)

11:10 -12:10 金利の期間構造とその応用 座長:山田 雄二(筑波大学大学院 ビジネス科学研究科)

Robust Yield Curve Arbitrage in Hedge Funds under Model Uncertainty
中村 信弘(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

償還期間を固定化したトランシェから成る CMO に対する価格付け: 解析解取得への試み
田村 勉(格付投資情報センター)

12:10-13:40 昼休み, 理事会・評議員会

13:40-14:10 総会

14:20 -15:50 最適戦略・最良執行 座長:石井 昌宏(大東文化大学 経営学部)

Good Deal Bounds Induced by Shortfall Risk
新井 拓児(慶應義塾大学 経済学部)

Optimal Execution in a Market with Small Investors
石井 良輔(京都大学 経済研究所 学振PD)

マルコフ過程に対する複数回行使型最適停止問題とその経路依存型オプションへの応用
一連続時間の場合一

穴太 克則,

瀬古 進(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC) 研究部)

16:00 -17:30 データ分析 座長:中妻 照雄(慶應義塾大学 経済学部)

レジーム・スイッチング因子分析とその応用

石島 博(中央大学大学院 国際会計研究科),

松島 純之介(中外製薬)

インカム・アプローチ及びパネル・データ・アプローチに基づく無形資産価値評価モデルについて
山口 智弘(三菱UFJ信託銀行 株式運用部 クオন্ツ運用グループ)

ヘッジファンドのリターン分析と自己回帰性について

三浦 良造(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科),

青木 義充(QUICK),

横内 大介(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

会場案内

成城大学 3号館 2階 321教室

東京都世田谷区成城 6-1-20



- 小田急線「成城学園前」駅 徒歩3分
(「急行」は停車しますが、「快速急行」は通過しますのでご注意ください)

2008年7月7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

金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当