

JAFEE

2012

冬季大会 プログラム

2013年1月25日(金)

2013年1月26日(土)

於：筑波大学 東京キャンパス文京校舎 134講義室

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 03-4212-3112

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

2013年1月25日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付開始

9:30 -10:30 信用リスクⅠ 座長:大野 忠士(筑波大学ビジネスサイエンス系)

マルチセグメントデータに対する同時最適化手法を用いた信用スコアリングモデルの構築
山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

格付判別を対象とした逐次ロジットモデルと SVM の比較実証
田中 克弘
中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

10:45 -11:45 信用リスクⅡ 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

Measuring Credit Risk of Individual Corporate Bonds and Deriving Term Structures of Default Probabilities

刈屋 武昭(明治大学グローバル・ビジネス研究科), 山村 能郎(同左), 乾 孝治(同左)
王 竹(ZWシステム)

小企業向け保全別回収率モデルの構築と実証分析

尾木 研三(日本政策金融公庫 国民生活事業本部 リスク管理部), 戸城 正浩(同左)
枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

11:45-13:15 昼休み, 理事会・評議員会(於:116教室)

13:15-13:45 総会

14:00 -15:00 派生証券 座長:中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Optimal Approximation of Basket Options: Application and Comparison with Super-Hedging Strategy

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

無担保デリバティブ評価の新しいパラダイム、双務的 CVA に代わる、CVA+FVA のアプローチ
高田 勝己(Diva Investments)

15:15 -16:45 統計的技法Ⅰ 座長:中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

VaR モンテカルロシミュレーションの GPU 高速化

亀山 裕亮(富士通研究所), 本間 克己(同左), 佐藤 裕一(同左), 佐々木 正信(富士通総研)

安定性を考慮した業者間取引データを用いたイールドカーブの推定手法

池田 弘(富士通研究所), 阿部 卓哉(日本相互証券), 佐々木 正信(富士通総研)
佐藤 裕一(富士通研究所), 松岡 英俊(同左)

The Analysis of Currency Crises A Dynamic Probit Model

Nguyen Duc Lap(広島修道大学)

17:00 -18:30 統計的技法Ⅱ 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

Stochastic Vine Copula -Particle Filtering Approach-

中村 信弘(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

分数関数プロセスをもつ GARCH モデルによる株価時系列解析

高石 哲弥(広島経済大学経済学部)

Segmentation Analysis of Multivariate Time Series of Foreign Exchange Rates

佐藤 彰洋(京都大学大学院情報学研究科)

Zdzislaw Burda(Department of Theory of Complex Systems, Jagiellonian University)

2013年1月26日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:00 大会受付開始

9:30 -11:00 信用リスクⅢ 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

フィナンシャルストレス予測モデル

大野 忠士(筑波大学ビジネスサイエンス系), 椿 広計(情報・システム研究機構, 統計数理研究所)

信用リスクデータベース(CRD)の決算書データに対するKNN法による欠損値補完

山下 智志(統計数理研究所), 高橋 淳一(総合研究大学院大学)

価格評価モデルによる地方債の信用リスクの推定

津田 博史(同志社大学理工学部), 渡辺 中穂美(同左)

11:15 -12:15 オルタナティブ投資 座長:山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

Dynamic Price Linkage and Volatility Structure between Carbon Markets

金村 宗(J-POWER)

個別不動産の投資リターン時系列の推定と応用

石島 博(中央大学大学院国際会計研究科), 前田 章(東京大学教養学部附属教養教育高度化機構)

谷山 智彦(野村総合研究所)

12:15-13:15 昼休み

13:15 -14:15 市場リスク 座長:津田 博史(同志社大学理工学部)

人工市場を用いた値幅制限・空売り規制・アップティックルールの検証

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント, 東京大学大学院工学系研究科)

和泉 潔(東京大学大学院工学系研究科, JSTさきがけ), 八木 勲(神奈川工科大学情報学部)

吉村 忍(東京大学大学院工学系研究科)

分布の適合度分析と Value-at-Risk 推定への応用 — 市場リスク計測におけるリスクフェーズ区分の設定 —

吉田 洋一(千葉商科大学大学院政策研究科, ゆうちょ銀行業務監査室)

14:30 -15:30 ポートフォリオ 座長:後藤 順哉(中央大学理工学部)

取引コストを考慮した最適資産配分問題 — DFO 手法を用いた最適乖離許容領域の決定 —

枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部), 山本 零(三菱UFJトラスト投資工学研究所)

田辺 隆人(数理システム), 今井 義弥(同左)

パーティクルフィルタによる4ファクター確率ボラティリティ金利モデルの推定と債券アービトラージ戦略への応用

島井 祥行(みずほ銀行)

15:45 -16:45 リスク管理 座長:中川 秀敏(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

シナリオ割当確率方式による財政危機確率分析モデルの研究

木村 哲(明治大学グローバル・ビジネス研究科)

預金者行動を考慮したコア預金モデルの構築

影井 智宏(浜銀総合研究所情報戦略コンサルティング部), 佃 良彦(東北大学)

小柳 誠(浜銀総合研究所情報戦略コンサルティング部)

17:00 -18:00 企業価値 座長:石島 博(中央大学大学院国際会計研究科)

企業の社会的責任(CSR)と企業価値評価について

安藤 雅和(千葉工業大学社会システム科学部), 津田 博史(同志社大学理工学部)

退職給付制度と企業価値について

田中 園子(慶應義塾大学), 高橋 大志(同左)

会場案内

筑波大学 東京キャンパス文京校舎 134講義室

東京都文京区大塚3-29-1



■東京メトロ・丸ノ内線『茗荷谷駅・出口1』から徒歩2分

2012年11月23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 03-4212-3112

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当