

JAFEE

2015

夏季大会 プログラム

2015年8月7日(金)

2015年8月8日(土)

中央大学・市ヶ谷田町キャンパス

主催：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

2015年8月7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 -11:00 リスク管理 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

An Empirical Analysis of the Discontinuance of Business for Startup Contractors and Property Companies in Japan

紺野 由希子(経済産業研究所)

Vine Copula を用いた与信ポートフォリオの信用ストレステスト

川口 宗紀(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

Credit Contagion を考慮した与信ポートフォリオの Name Concentration について

朴 晃一(大阪大学大学院経済学研究科), 大西 匡光(同左)

11:15 -12:15 デフォルトリスク 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

トレーディング取引のデフォルトリスク評価: 簡素な内部モデルの構築と考察

守谷 嘉洋(日本銀行金融研究所)

Evaluation of Multi-asset Equity Values with Default Risk using Additive Models

山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

12:15-13:15 昼休み

13:15 -14:15 アセットプライシング 座長:山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

Information Mirage and Belief Formation in Experimental Asset Markets

北村 智紀(ニッセイ基礎研究所), 中里 宗敬(青山学院大学大学院国際マネジメント研究科)

日本株式のサイズ・プレミアム ~等金額加重・規模別分位ポートフォリオによる日米34年間の再検証~

山口 勝業(イボットソン・アソシエイツ・ジャパン), 小松原宰明(同左)

14:30 -16:00 株価収益率分析 座長:三浦 良造(一橋大学名誉教授)

複雑ネットワークに基づく株価収益率の自動分類に関する研究

磯貝 孝(日本銀行金融機構局)

Estimating the U.S. Equity and Bond Risk Premiums Using a Quadratic Gaussian Joint Pricing Model

菊池 健太郎(滋賀大学経済学部)

株価収益率相関行列による東京証券取引所における市場不安定性の動的分析

高石 哲弥(広島経済大学経済学部)

16:15 -17:15 人工市場・テキストマイニング 座長:山田 隆志(山口大学国際総合科学部)

人工市場シミュレーションを用いた取引システムの高速化が価格形成に与える影響の分析

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント), 則武 誉人(日本証券クリアリング機構),

早川 聡(大阪取引所), 和泉 潔(東京大学大学院工学系研究科, 科学技術振興機構CREST)

Deep Learning によるニュース記事の評判分析

五島 圭一(東京工業大学), 高橋 大志(慶應義塾大学大学院経営管理研究科),

寺野 隆雄(東京工業大学大学院総合理工学研究科)

17:30 -18:30 コモディティ・不動産市場 座長:金村 宗(京都大学大学院総合生存学館)

センチメント・インデックスの株価と不動産価格の予測可能性

石島 博(中央大学大学院国際会計研究科), 数見 拓朗(大阪大学, サイバーエージェント),

前田 章(東京大学大学院総合文化研究科)

Commodity Spot and Futures Prices under Supply, Demand, and Financial Trading

中島 克志(立命館アジア太平洋大学国際経営学部)

2015年8月8日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

8:30 大会受付開始

9:00 -10:00 統計的方法 座長:石田 功(甲南大学経済学部)

Does Stock Trading with Dynamic Bayesian Networks Work? Evidence in the Japanese Stock Market

大古田 純(慶應義塾大学経済学部), 中妻 照雄(同左)

Dynamic Hedging Strategy using Stochastic Vine Copulas

野澤 勇樹(一橋大学大学院国際企業戦略研究科), 中村 信弘(同左)

10:15 -11:15 高頻度データⅠ 座長:中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

呼値単位の適正化が高頻度取引の発生強度に与える影響

大槻 健太郎(QUICK), 青木 義充(同左), 横内 大介(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

Dynamic Error Correction Model for Co-Integrated Stocks using High-Frequency Data

Napoleon(一橋大学大学院国際企業戦略研究科), 中村 信弘(同左)

11:30 -12:30 高頻度データⅡ 座長:林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科)

レジーム転換を考慮した価格調整モデルの推定

千葉 賢(福井工業大学環境情報学部)

高頻度複数気配データを用いた日経225先物取引におけるマーケット・インパクトに対する実証分析

荻原 哲平(統計数理研究所統計思考院), 加藤 恭(大阪大学大学院基礎工学研究科),

高田 英行(東邦大学理学部)

12:30-13:30 昼休み, 理事会・評議員会

13:30-14:00 総会

14:00 -15:30 ポートフォリオ最適化 座長:山本 零(武蔵大学経済学部)

レジームスイッチヴァインコピュラモデルに基づく金融資産リターンの予測とダウンサイドリスク管理ポートフォリオの構築

中村 竜二(一橋大学大学院国際企業戦略研究科)

シンプルなスマートベータ構築ルール: 効用関数最大化とポートフォリオ回転率抑制を具現化するポートフォリオ構築ルール

南 聖治(りそな銀行), 若月 哲郎(同左)

分位点回帰による期待ショートフォール最適化とポートフォリオ選択

中島 湧生(慶應義塾大学経済学部), 高梨 耕作(慶應義塾大学大学院経済学研究科),

中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

15:45 -16:45 期間構造モデル 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

Credit Slope Trading Strategy Using the Dynamic Nelson-Siegel Model

小林 武(名古屋商科大学経済学部)

フォワードレートモデルの実確率測度への適用

齋藤 要(首都大学東京社会科学部)

17:00 -18:00 確率モデル 座長:新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

A Categorical Interpretation of Logical Formulae involving Stochastic Processes

足立 高德(立命館大学理工学部)

Numerical Results for Stochastic Differential Equations via Parametrix Method

田口 大(立命館大学大学院理工学研究科), 田中 佑弥(第一フロンティア生命保険)

会場案内

中央大学・市ヶ谷田町キャンパス

〒162-8478 東京都新宿区市ヶ谷田町1-18



- 東京メトロ 南北線・有楽町線 / 市ヶ谷駅(6番出口)徒歩1分
- JR中央・総武線 / 市ヶ谷駅(A1出口)徒歩約5分
- 都営地下鉄新宿線 / 市ヶ谷駅(A1出口)徒歩約5分

2015年6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

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