

JAFEE

2019

夏季大会 プログラム

2019年8月5日(月)

2019年8月6日(火)

於：成城大学 3号館2階 322教室

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

〒105-0004 東京都港区新橋6-7-9 新橋アイランドビル3階

公益総研株式会社 JAFEE担当

TEL 03-5405-1816 (事務センター代表)

FAX 03-5405-1814

Email office@jafee.gr.jp

2019年8月5日(月)

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 株式投資 座長:山本 零(慶應義塾大学理工学部)

株式とETFの裁定取引にかかるコストと流動性の関係 —人工市場によるシミュレーション分析—
水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント)

ロバスト回帰モデルによる業種別リビジョンインデックスの予測とその応用
白熊 ルネ(野村アセットマネジメント), 青木 義充(エフビズ), 工藤 秀明(野村アセットマネジメント),
渋谷 淳(QUICK), 大槻 健太郎(同左)

10:45-12:15 信用リスク 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所、中央大学ビジネススクール)

入出金情報を用いた信用リスク評価 —機械学習による実証分析—
三浦 翔(みずほ第一フィナンシャルテクノロジー), 井實 康幸(りそな銀行),
竹川 正浩(CRD協会(現・あずさ監査法人))

銀行口座の入出金情報に基づく個人の行動特性を考慮したカードローンのデフォルト分析とモデル化
上武 治紀(りそな銀行), 吉田 博哉(りそな銀行), 枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

買収に伴う資金調達行動が財務レバレッジとデフォルトリスクに与える影響分析
村上 暢子(PwCコンサルティング), 山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

12:15-14:15 昼休み、代議員会・理事会

※ 今回はJAFEE会長・代議員・理事が交代する手続きがあるため、通常よりも長時間になります。
何卒ご了承ください。

14:15-15:45 高頻度データ 座長:小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

金融資産の価格の共分散行列の予測において正定値性を保証したモデルの紹介
中澤 碧斗(関西学院大学大学院理工学研究科)

Detecting Factors of Quadratic Variation in the Presence of Market Microstructure Noise
国友 直人(明治大学政治経済学部), 栗栖 大輔(東京工業大学工学院)

Realized Networks による日本株の依存構造分析
重本 秀人(関西学院大学大学院理工学研究科)

16:00-17:30 数理ファイナンス 座長:新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

Optimal Execution Strategies with Generalized Price Impacts in a Continuous-time Setting
深澤 正彰(大阪大学大学院基礎工学研究科), 大西 匡光(大阪大学大学院経済学研究科),
下清水 慎(大阪大学大学院経済学研究科)

Utility Indifference Pricing and the Aumann and Serrano Index
程島 次郎(名古屋商科大学ビジネススクール マネジメント研究科),
宮原 孝夫(名古屋市立大学大学院経済学研究科)

A Binomial Asset Pricing Model in a Categorical Setting
足立 高德(首都大学東京大学院経営学研究科), 中島 克志(立命館アジア太平洋大学国際経営学部),
琉 佳勳(立命館大学理工学部数理科学科)

17:45-19:45 懇親会(於:7号館地下・SEIJO LOUNGE)

2019年8月6日(火)

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 イールドカーブ 座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

Global Bond Market Interaction: An Arbitrage-free Dynamic Nelson Siegel Modeling Approach
小林 武(名古屋商科大学ビジネススクール マネジメント研究科)

Pricing Interest Rate Derivatives after Ibor Fallback
長谷川 貴博(オメガ・パートナーズ)

10:15-11:15 オプション市場 座長:足立 高德(首都大学東京大学院経営学研究科)

Recovery Theorem を用いた資産価格変動要因の分解 ー米国株式指数を用いた実証分析ー
霧生 拓也(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)), 枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

ODE-Based Bayesian Inference of VIX Dynamics Adapted to VIX Futures, VWXs, and VIX Options
中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

11:30-12:30 派生証券 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

A Weak Approximation Scheme for Hypocoelliptic Diffusions and Applications
井口 優雅(三菱UFJ銀行), 山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

卸電力取引市場における太陽光発電事業収益変動リスクヘッジのための統合デリバティブポートフォリオ
松本 拓史(筑波大学大学院ビジネス科学研究科), 山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

12:30-13:30 昼休み

13:30-13:45 JAFEE論文賞・JAFEE若手論文賞 授賞式

13:45-15:15 金融特別セッション「金融機関におけるデータサイエンスの課題と展望」

司会:荒川 研一(りそな銀行 リスク統括部)

講演1:金融機関におけるデータサイエンスの動向

桑津 浩太郎(野村総合研究所 研究理事 未来創発センター・センター長 コンサルティング事業本部 副本部長)

講演2:TBA

関口 朋宏(ブレインパッド ビジネス統括本部 本部長)

講演3:リアルデータの時代 ~位置情報はマーケティングをどう変えるか?~

岡本 雅史(シナラシステムズジャパン 営業統括部 ポストセールス ディレクター)

講演4:TBA

大字 沙織(エクサウィザーズ AIプロダクト事業部 FinTechグループ 事業部長)

15:30-16:30 データ分析 I 座長:林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科)

ビットコイン時系列におけるマルチフラクタル相互相関

高石 哲弥(広島経済大学経済学部), 足立 高德(首都大学東京大学院経営学研究科)

自己回帰条件付きポアソンモデルに基づく株価収益率のジャンプの推定

守屋 奨悟(関西学院大学大学院理工学研究科)

16:45-17:45 データ分析 II 座長:佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)

Topological Data Analysis を利用したボラティリティの動向分析

角田 友将(富士通), 佐々木 正信(富士通総研), 伊海 佳昭(富士通研究所), 梅田 裕平(同左),
山影 謙(富士通)

一般化 t-過程回帰の経済データ分析への応用

内山 祐介(MAZIN)

会場案内

成城大学 3号館2階 322教室

〒157-8511 東京都世田谷区成城6-1-20



■小田急線・成城学園前駅 正門まで下車徒歩3分

2019年7月8日発行

発行 日本金融・証券計量・工学学会 (JAFEE)

制作 〒105-0004 東京都港区新橋6-7-9

新橋アイランドビル3階

公益総研株式会社 JAFEE担当

TEL 03-5405-1816(事務センター代表)

FAX 03-5405-1814

Email office@jafee.gr.jp