

JAFEE

2020

夏季大会 プログラム

2020年8月29日(土)

Zoomによるオンライン開催

会場A : Webinar 1

会場B : Webinar 2

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

2020年8月29日(土)

※報告時間:コンペティションは15分(質疑応答も含む)。一般発表は30分(質疑応答も含む)

※会場AはWebinar 1、会場BはWebinar 2 ※会議室IDとパスワードは別途通知します

9:00-10:30 (会場A) コンペティション I

座長:小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

HAR モデルを用いた日本の個別株式における
Realized Volatility の予測

若林 大貴(PwCあらた有限責任監査法人)

重み付きグラフィカル lasso による累積共分散逆行列
の推定

重本 秀人(関西学院大学理工学研究科)

SIML Method in terms of Fourier-Malliavin
Framework

渡部 敦仁(立命館大学大学院理工学研究科),
赤堀 次郎(同上), 難波 隆弥(同上)

カバー付き金利平価からの乖離を利用した為替フォ
ワード取引

雫子波 晶(茨城大学大学院理工学研究科), 柳澤 弘毅(同左),
杉本 誠忠(ワイジェイFX), 酒本 隆太(岡山大学社会文化科学
研究科), 鈴木 智也(茨城大学大学院理工学研究科)

金融資産の価格変動におけるべき乗則の検出と評価

柿中 晋治(京都大学大学院情報学研究科)

Queue-Reactive Hawkes 過程を用いた注文発生と待ち
注文数量がその後の注文発生強度に与える影響の分析

野原 真(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)),
中川 秀敏(一橋大学大学院経営管理研究科)

10:50-12:05 (会場A) コンペティション II

座長:安田 和弘(法政大学理工学部)

確率的関数近似における KYZ 対応とその応用について

仙葉 隼裕(立命館大学大学院理工学研究科),
赤堀 次郎(同上)

前進後退確率微分方程式による一般均衡の特徴づけと
その応用

森田 大輝(立命館大学大学院理工学研究科)

Doob の h 変換および Pitman の $2M-X$ 型変換のファ
イナンスへの応用について

福島 貴太(立命館大学大学院理工学研究科),
赤堀 次郎(同上),
今村 悠里(金沢大学理工研究域)

Improved Hoeffding Inequality for Dependent
Bounded or Sub-gaussian Random Variables

田上 悠太(早稲田大学ビジネス・ファイナンス研究センター)

Optimal Execution of Pair Trading with
Generalized Price Impacts

大西 匡光(大阪大学大学院経済学研究科),
下清水 慎(同上)

9:30-10:30 (会場B) ボラティリティ【一般発表】

座長:林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科)

<9:30開始>

Can Burning Cash Predict Increased Equity
Volatility during the Covid-19 Crisis?

桜井 悠司(FRB Richmond)

※9:30-10:00

確率的ボラティリティモデルに対する可解な動的ポ
ートフォリオ問題

内山 祐介(MAZIN),
中川 慧(野村アセットマネジメント)

※10:00-10:30

10:50-11:50 (会場B) ESG【一般発表】

座長:山内 浩嗣(MTEC、中央大学)

ESG スコアと株式投資リターンのパフォーマンス検証

橋本 英樹(QUICK)

※10:50-11:20

ESG を考慮した CAPM

石島 博(中央大学大学院法務研究科),
前田 章(東京大学大学院総合文化研究科)

※11:20-11:50

12:05-13:00 昼休み

13:00-14:15 (会場A) コンペティションⅢ

座長: 山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

ニュースヘッドラインの機械学習によるアクティブ運用

細木 唯以(茨城大学大学院理工学研究科),

江口 潤一(大和アセットマネジメント),

鈴木 智也(茨城大学, 大和アセットマネジメント)

円相場における日本特有のゴトウピアノマリー

秋山 朋也(茨城大学大学院理工学研究科),

堀之内 智(ザイFX! 編集部), 杉本 誠忠(ワイジェイFX),

酒本 隆太(岡山大学社会文化科学研究科),

鈴木 智也(茨城大学大学院理工学研究科)

自己符号化器に基づく国債イールドカーブモデルの構築と解釈

水門 善之(東京大学大学院工学系研究科),

和泉 潔(同上), 坂地 泰紀(同上),

島田 尚(同上)

解釈性を持つリスクファクター構成手法に関する研究

野間 修平(野村アセットマネジメント), 中川 慧(同左)

マクロ経済変数を含んだ INAR モデルによる倒産リスク伝播構造の推定とストレステストへの応用

監物 輝夫(一橋大学大学院経営管理研究科)

14:30-15:30 (会場A) 不確実性【一般発表】

座長: 室井 芳史(東北大学経済学研究科)

銀行行動のミクロ経済的モデル化について

瀧野 一洋(名古屋商科大学ビジネススクール),

石椏 義和(神戸市外国語大学外国語学部)

Numerical Methods for Hedging Bermudan Options under Model Uncertainty

今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

15:45-16:45 (会場A) 暗号通貨【一般発表】

座長: 足立 高德(東京都立大学経営学研究科)

ビットコイン収益率とボラティリティの相互相関におけるべき法則

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

Linguistic Analysis of Cryptocurrency Pump and Dump Schemes on Telegram

土屋 太郎(慶應義塾大学経済学部)

13:15-14:15 (会場B) パフォーマンス測定【一般発表】

座長: 新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

<13:15開始>

On the Appropriate Performance Measure based on the Aumann-Serrano Index

程島 次郎(名古屋商科大学経済学部)

※13:15-13:45

積立投資でリスクはいつ取るべきか? バランス・ファンド vs TDF のLPM(下方部分積率)比較

山口 勝業(イボットソン・アソシエイツ・ジャパン),

小松原 幸明(同上)

※13:45-14:15

14:30-15:30 (会場B) 機械学習【一般発表】

座長: 和泉 潔(東京大学大学院工学系研究科)

高頻度金融データとGANを用いたデータ拡張

成富 佑輔(東京都立大学大学院経営学研究科、MTEC),

足立 高德(東京都立大学大学院経営学研究科)

スペクトル分析の行動ファイナンス的解釈

王 京穂(明治大学データアナリティック研究所)

15:45-16:45 (会場B) 金利の期間構造【一般発表】

座長: 高見澤 秀幸(中央大学商学部)

PDE-Based Bayesian Inference: Some Applications to FBSDEs in Finance

中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

A Global Model of International Yield Curves: Regime-Switching Dynamic Nelson Siegel Modeling Approach

小林 武(名古屋商科大学ビジネススクール)

16:45-17:15 (会場A:Webinar 1) コンペティション表彰式

Zoomによるオンライン開催

会場A : Webinar 1

会場B : Webinar 2

※会議室IDとパスワードは別途通知します

2020年7月16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