

JAFEE

2021

冬季大会 プログラム

2022年2月19日(土)

Zoomによるオンライン開催

会場A : Meeting Room 1

会場B : Meeting Room 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

2022年2月19日(土)

※報告時間:若手ショートコミュニケーションは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Meeting Room 1、会場BはMeeting Room 2

※会議室IDとパスワードは別途通知します

9:00-10:45 (会場A) 若手ショートコミュニケーション

座長:小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

A New Class of Malliavin Mancino Type Spot
Volatility Estimators

神原 玲花(立命館大学大学院理工学研究科)

1次元拡散過程の拡散係数の深層ニューラルネットワークを用いたノンパラメトリック推定

鈴木 海舟(東京大学大学院数理科学研究科)

A Direct Method for Solving Hamilton-Jacobi-Bellman Equations via Deep Learning

瀬尾 誠人(立命館大学大学院理工学研究科)

Variational Deep Solver of Variational Inequalities

森時 幸司(立命館大学大学院理工学研究科)

Concentration Inequality of Sums of Dependent Subexponential Random Variables and Application to Bounds for Value-at-Risk

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)

Deep Stochastic Hamiltonian System

仙葉 翔伍(立命館大学大学院理工学研究科)

Diffusion Estimation by Signature and Malliavin-Mancino Method

平野 貴稔(立命館大学大学院理工学研究科)

11:15-12:15 (会場A) 統計的方法【一般発表】

座長:中妻 照雄(慶應義塾大学経済学部)

局所線形極値分位点回帰

栗栖 大輔(東京工業大学工学院),

大津 泰介(London School of Economics)

日本株式市場における効率性の長期時間変動

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

9:15-10:45 (会場B) 信用リスク I【一般発表】

座長:山内 浩嗣(MTEC、中央大学)

【本セッションは9:15スタートです】

Examining the Default Prediction Power of Corporate Managers' Sentiment

山中 卓(青山学院大学理工学部、

東京工業大学科学技術創成研究院),

大里 隆也(滋賀大学データサイエンス教育センター)

※9:15-9:45

コロナ禍における市場金利での企業の倒産リスク評価と考察

谷口 友哉(滋賀大学大学院データサイエンス研究科),

大里 隆也(滋賀大学データサイエンス教育センター)

※9:45-10:15

多変量マルコフ局面転換モデルを用いた金利・信用スプレッドのデータ分析

畠山 直人(農林中央金庫、

東京都立大学大学院経営学研究科)

※10:15-10:45

11:15-12:15 (会場B) 信用リスク II【一般発表】

座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

Modeling Self and Mutual Excitations in Credit Default Swaps: Bayesian Statistical Inference

中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

CVA における実務的な誤方向リスクモデルの考察

五十嵐 純平(東京都立大学大学院経営学研究科)

12:15-13:30 昼休み

(12:15~12:35:日本経済新聞社によるオンライン広告[会場A、会場B])

<次のページに続く>

13:30-15:00 (会場A) 高頻度データ分析【一般発表】

座長: 佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)

分散と相関ダイナミクスに時間変動するパラメータを導入した Realized DCC モデル

重本 秀人(関西学院大学大学院理工学研究科),
森本 孝之(関西学院大学理学部)

東京証券取引所におけるETFマーケットメイク制度導入の先行遅延関係への影響分析

林 高樹(慶應義塾大学大学院経営管理研究科),
小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

米国日中株式データによる小型株効果分析

岩本 菜々(兵庫県立大学情報科学研究科
兼 社会情報科学部)**15:30-17:00 (会場A) リスク管理【一般発表】**

座長: 室井 芳史(東北大学大学院経済学研究科)

気候変動リスクの有価証券報告書開示スコア算出法
~ダブルサーチ&コサイン法(テキストマイニング)によるスコア化~南 聖治(りそなアセットマネジメント), 若月 哲郎(同左),
河合 祐二郎(同上), 松原 稔(同上),
花城 輝樹(同上)

地域銀行のビジネスモデル転換と金融危機時に顕在化するリスクに関する分析

石井 一成(東京都立大学大学院経営学研究科,
三菱総合研究所)

混合ポアソン過程による一般化クラメル-ルンドベリモデルの破産確率について

富田 昌(明治安田生命),
高岡 浩一郎(中央大学商学部), 石坂 元一(同左)**13:30-15:00 (会場B) 派生商品評価【一般発表】**

座長: 山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

Pricing Multi-asset Derivatives by Finite Difference Method on a Quantum Computer

宮本 幸一(大阪大学量子情報・量子生命研究センター),
久保 健治(メルカリ R4D, 大阪大学基礎工学研究科)

Dimension Reduction for a Quasi-Monte Carlo Method via Quadratic Regression

今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

デジタルおよびバリアオプションに対する Deep Hedging の学習性能の評価

樋口 智英(野村證券),
米田 亮介(京都大学大学院情報学研究科),
小林 望(野村證券), 藤田 政文(ノムライインターナショナルPLC)**15:30-17:00 (会場B) 数理モデル【一般発表】**

座長: 安田 和弘(法政大学理工学部)

Discrete Signature and its Application to Finance

足立 高德(東京都立大学大学院経営学研究科),
成富 佑輔(同上)

A Viscosity Solution as a Piecewise Classical Solution to an Optimal Switching and Free Boundary Problem with Simultaneous Multiple Switches

鈴木 清(野村證券)

Execution Game in a Markovian Environment

大西 匡光(大阪大学大学院経済学研究科,
大阪大学 数理・データ科学教育研究センター),
下清水 慎(東京都立大学大学院経営学研究科)

Zoomによるオンライン開催

会場A : Meeting Room 1

会場B : Meeting Room 2

※会議室IDとパスワードは別途通知します

2022年1月18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