

JAFEE

2022

夏季大会 プログラム

2022年8月19日(金)

2022年8月20日(土)

於：8/19(金)：成城大学 3号館2階 322教室 + Zoomオンライン会場
8/20(土)：Zoomオンライン会場のみ

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8月19日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

※発表は成城大学の大会会場で行います

※聴講は成城大学の大会会場かZoom Webinar会場のいずれかにご参加ください

※Zoom Webinarの会議室IDとパスワードは別途通知します

12:30 大会受付開始

13:00-14:30 数理モデル 座長:安田 和弘(法政大学理工学部)

高次元主成分分析を使用した共分散予測モデルの構築

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)

Joint Mixability and Negative Orthant Dependence

小池 孝明(一橋大学大学院経済学研究科),

Liyuan Lin (Department of Statistics and Actuarial Science, University of Waterloo),

Ruodu Wang (同上)

ラティス法によるレヴィ過程におけるオプション価格評価について

室井 芳史(東北大学大学院経済学研究科),

須田 真太郎(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

14:45-15:45 金融特別セッション「不動産ファイナンスの最近の話題」

司会:荒川 研一(りそな銀行リスク統括部)

講演1: 不動産ファイナンスにおける最近のトピックス

石島 博(中央大学大学院法務研究科 教授、日本金融・証券計量・工学学会(JAFEE) 代議員・理事、

日本不動産金融工学学会(JAREFE) 会長、アジア不動産学会(AsRES) 会長)

講演2: サステナブル不動産を巡る動向～脱炭素社会の実現に向けた金融の役割～

高木 大輔(中央大学企業研究所客員研究員)

16:00-17:30 データ分析 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)

創業企業向け信用リスクモデルにおける人的要因の有効性 — 創業時の年齢と斯業経験年数の効果 —

尾木 研三(専修大学商学部),

峰下 正博(日本政策金融公庫国民生活事業本部),

枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

国内企業の決算説明会における話者の感情と業績の関係 — テキスト・音声による感情分析 —

橋本 英樹(QUICK)

マクロ経済アナウンスメントがリスクプレミアム・リスク・選好に与える影響

霧生 拓也(大阪大学大学院経済学研究科),

枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

17:35-17:55 JAFEE論文賞・若手優秀論文賞 授賞式

2022年8月20日(土)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

※発表・聴講はすべてZoom Webinar会場で行います。Zoomの会議室IDとパスワードは別途通知します

10:00-12:00 2022 JAFEE Summer Meeting – KAFE Special Session

Chair: Jiro Akahori (Professor at Department of Mathematical Sciences, Ritsumeikan University)

ESG Lending

Jongsub Lee (Seoul National University)

Overshooting House Price Cycle and Fundamental Value: Credit Driven Demand versus Jeonse

Sooyoung Song (Chung Ang University)

Recursive Utility and DTI Limits

Byung Hwa Lim (Sungkyunkwan University)

Common Macro Factors in Credit Risk

Haerang Park (Bank of Korea)

12:00-13:00 昼休み

13:00-14:30 人工市場・機械学習 座長:小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

投資戦略の最適化の不安定性による金融市場の不安定性 -人工市場を用いた分析-

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント), 八木 勲(工学院大学情報学部),

高島 幸成(長岡大学経済経営学部)

機械学習モデルを用いた日本における新型コロナウイルスの 地方債市場への影響に関する考察

丹波靖博(西南学院大学経済学部), 原口 健太郎(西南学院大学商学部)

人工市場シミュレーションを用いた買い注文の超過による影響の調査

則武 誉人(三井住友DSアセットマネジメント), 水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント),

逸見 龍太(三井住友DSアセットマネジメント),

南雲 将太(日本証券クリアリング機構、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)

14:45-15:45 気象リスク 座長:山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

気候変動シナリオデータを利用した水害損失リスクの計量モデル

樋口 智英(野村証券), 水門 善之(同左), 中川 秀敏(一橋大学大学院経営管理研究科)

Standardized Multivariate Weather Derivatives for Hedging Risk in Wind Power Generation Businesses

松本 拓史(金沢大学融合研究域融合科学系), 山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系)

16:00-17:00 市場リスク 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

Arbitrage-Free Co-Integrated Term Structure Model of Interest Rates towards Yield Curve Arbitrage

中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

量子計算によるリスク指標計算の試み

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

17:30- 代議員会 ※Zoom会議室のIDとパスワードは代議員宛に別途通知します

会場案内

対面会場(8/19のみ)：成城大学 3号館2階 322教室

東京都世田谷区成城6-1-20

小田急線・成城学園前駅 大学正門まで徒歩3分



オンライン会場(8/19、8/20)：Zoom Webinar

※会議室IDとパスワードは別途通知します

2022年7月15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