

JAFEE

2022

冬季大会 プログラム

2023年2月18日(土)

2023年2月19日(日)

於：東北大学 川内キャンパス 文科系総合講義棟 2階
経済学部第1講義室
+ Zoomオンライン会場

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

2023年2月18日(土)

※報告時間:一般発表は30分(質疑応答も含む)。ショートコミュニケーションは15分(質疑応答も含む)。

※対面とZoomオンラインのハイブリッド開催です。セッション名の先頭に「*」がついているセッションはオンラインでの発表が含まれ(オンライン発表のタイトルの末尾には「*」を付けてあります。)、無印のものは対面で発表されます。Zoom会議室のIDとパスワードは別途通知します。

10:00-11:00 * 株式市場の分析 I 座長:山内 浩嗣(三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)、中央大学)

新しい株式投資戦略は既存の戦略からリターンを奪うのか?-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)

株式公開が企業の資金調達に及ぼす影響*
橋本 樹(滋賀大学大学院データサイエンス研究科)

11:10-12:10 * JUMPモデル 座長:今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

Exploring Cointegrated Asset Dynamics: The Impact of Stochastic Variances and Mutually Exciting Jumps*
中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

確率的レバレッジ効果がオプション市場のインプライド・スキューに与える影響:自己励起ジャンプモデルとの比較*
渡邊 裕也(SMBC日興証券), 中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

12:10-13:50 昼休み

13:50-14:50 数理ファイナンス 座長:赤堀 次郎(立命館大学大学院理工学研究科)

Continuous-Time Optimal Execution in a Markovian Environment
深澤 正彰(大阪大学大学院基礎工学研究科), 大西 匡光(大和大学政治経済学部),
下清水 慎(東京都立大学大学院経営学研究科)

Deep Learning-Based Option Pricing for Barndorff-Nielsen and Shephard Model
新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

15:00-16:00 イールドカーブ 座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

Decomposing Asian Countries Yield Curve Comovement
小林 武(名古屋商科大学大学院会計ファイナンス研究科)

RFR 下における caplet の評価について
竹田 凌(東京都立大学大学院経営学研究科), 竹原 浩太(同左), 室町 幸雄(同左)

<次ページに続く>

16:10-17:25 ショートコミュニケーション I 座長:安田 和弘(法政大学理工学部)

Optimal Stopping of Ornstein Uhlenbeck Processes

JIA ZhiJie(立命館大学大学院理工学研究科), 森時 幸司(同左), 赤堀 次郎(同左)

Diversifying Meltdown Risk of Cryptocurrencies

鈴木 莞司(東京大学経済学部), 桜井 悠司(International Monetary Fund),
五島 圭一(早稲田大学産業経営研究所)

Randomized Positive-Definite Fourier Estimator

戸田 菜月(立命館大学大学院理工学研究科), 神原 玲花(同左), 赤堀 次郎(同左)

深層学習によりハミルトンヤコビベルマンの方程式を直接解く方法

芳賀 光樹(立命館大学大学院理工学研究科), 赤堀 次郎(同左), 瀬尾 誠人(同左)

A Non-parametric Multi-dimensional Volatility and Expected Return Estimator Via the Deep Propagator Model

松永 耕英(立命館大学大学院理工学研究科), Vu Huy Hoang (同左), 赤堀 次郎(同左)

17:35-18:35 デリバティブ 座長:新井 拓児(慶應義塾大学経済学部)

証拠金完備デリバティブ取引のカウンターパーティリスク

木谷 亮介(一橋大学大学院経営管理研究科)

アメリカンオプションに対する Deep Hedging の学習方法に関する考察

佐久間 達也(東京都立大学大学院経営学研究科), 足立 高德(同左), 竹原 浩太(同左),
湯浅 智意(同上)

2023年2月19日(日)

※報告時間:一般発表は30分(質疑応答も含む)。ショートコミュニケーションは15分(質疑応答も含む)。

※対面とZoomオンラインのハイブリッド開催です。セッション名の先頭に「*」がついているセッションはオンラインでの発表が含まれ(オンライン発表のタイトルの末尾には「*」を付けてあります。)、無印のものは対面で発表されます。Zoom会議室のIDとパスワードは別途通知します。

9:00-10:00 * ショートコミュニケーション II 座長:小池 祐太(東京大学大学院数理科学研究科)

取引者の注文分割仮説に基づく注文流の長期記憶性の説明*

佐藤 優輝(筑波大学大学院理工情報生命学術院), 金澤 輝代士(筑波大学システム情報系)

Herding Effect of both Global and Local Crisis in BRICS Countries*

Marija Tatomir(慶應義塾大学大学院理工学研究科), 枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

決算短信テキスト情報の株価変動に対する有意性の検証*

松田 眞(同志社大学大学院理工学研究科), 津田 博史(同志社大学理工学部)

Market Price-Volatility Simulator

北野 力暉(立命館大学大学院理工学研究科), 平野 貴稔(同左), 赤堀 次郎(同左)

10:10-11:10 信用リスク I 座長:荒川 研一(りそな銀行リスク統括部)

A New Approach to Estimating Loss-Given-Default Distribution

江上 雅彦(京都大学大学院経済学研究科), Kevkhishvili Rusudan(同左)

非承認先の情報を活用した教育ローン向け信用スコアリングモデル

戸城 正浩(日本政策金融公庫国民生活事業本部), 引寺 佑輔(同左),

尾木 研三(専修大学商学部), 枇々木 規雄(慶應義塾大学理工学部)

11:20-12:20 株式市場の分析 II 座長:佐藤 整尚(東京大学大学院経済学研究科)

Financial Crisis : Stochastic Volatility and State Space Models

渡辺 泰明(近畿大学経営学部), Rand Kwong Yew Low(Bond Business School, Bond University)

Towards a Non-parametric Detection of a Market Bubble

木場 健太郎(立命館大学大学院理工学研究科), Vu Huy Hoang (同左), 赤堀 次郎(同左)

12:20-14:00 昼休み・理事会(理事会のZoom会議室のIDとパスワードは理事宛に別途通知します)

14:00-15:00 信用リスク II 座長:吉羽 要直(東京都立大学大学院経営学研究科)

アジア・オセアニア地域の社債に関するファクター分析

小畑 崇弘(アセットマネジメントOne), 佐藤 是礎(同左), 山口 滉平(同左), 城川 寛明(同左),

酒本 隆太(岡山大学大学院社会文化科学研究科)

銀行間競争下での融資スプレッド決定モデル

石井 昌宏(上智大学経済学部), 石坂 元一(中央大学商学部)

15:10-16:10 リスク管理 座長:塚原 英敦(成城大学経済学部)

バイジアンネットワークを用いた本邦市場の伝播構造の分析

小熊 陸(東京都立大学大学院経営学研究科)

非対称 t 接合関数を用いた株式ポートフォリオ・リスクの把握

吉羽 要直(東京都立大学大学院経営学研究科)

16:20-17:20 * 数値計算法 座長:室井 芳史(東北大学大学院経済学研究科)

Dimension Reduction via Neural Network for Enhancing Quasi-Monte Carlo Method*

今井 潤一(慶應義塾大学理工学部)

量子機械学習を利用したボラティリティモデル*

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

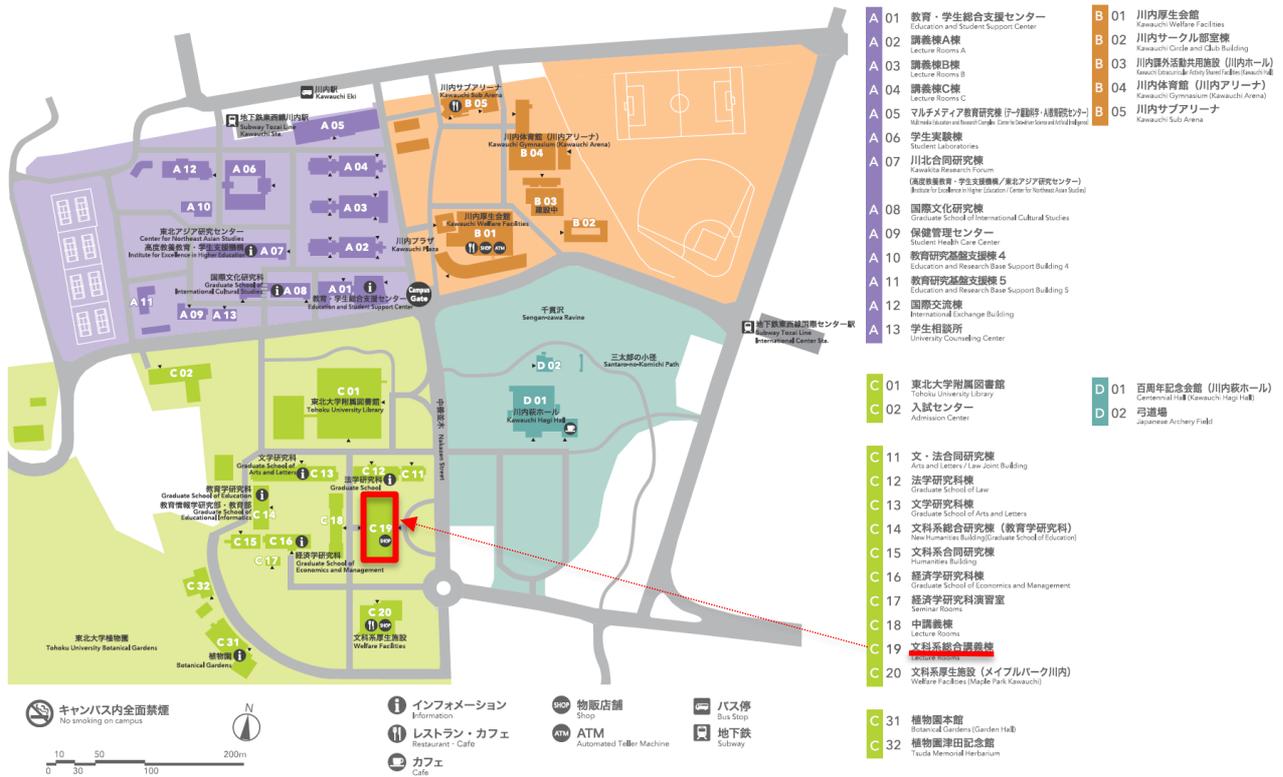
会場案内

対面会場：東北大学 川内キャンパス 文科系総合講義棟 2階
経済学部第1講義室

宮城県仙台市青葉区川内4-1
仙台市地下鉄東西線 川内駅(キャンパス直結)



東北大学 川内キャンパス
TOHOKU UNIVERSITY Kawauchi Campus



オンライン会場：Zoom Meetings

※会議室IDとパスワードは別途通知します

2023年1月20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@jafree.gr.jp