

JAFEE

2023

夏季大会 プログラム

2023年8月17日(木)

於：8/17(木)：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

2023年8月17日(木)

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 金融市場改革 座長:大本 隆(野村アセットマネジメント)

Free Boundary SABR for Backward-looking RFR Caplets
中島 亮(オメガ・パートナーズ)

Reforms and the Law of One Price in IRS Market
宮川 大介(早稲田大学商学部),
小田 剛正(日本銀行金融研究所),
曾根 泰平(日本銀行金融市場局)

10:45-12:15 信用リスク 座長:吉羽 要直(東京都立大学大学院経営学研究科)

倒産と回収率の依存関係を考慮したローン担保証券の価格評価モデルによる市場価格の分析
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)

現預金と限界利益からコロナ禍における企業の事業継続性に関する考察
川俣統吾(滋賀大学データサイエンス研究科、滋賀大学DEMLセンター),
大里隆也(帝国データバンク、滋賀大学DEMLセンター)

企業の炭素排出量と信用リスクの関係について
関 俊哉

12:15-13:45 昼休み

13:45-15:15 金融派生商品価格評価 座長:山田 俊皓(一橋大学大学院経済学研究科)

PDE-Based Bayesian Inference of Quadratic Variance Model for Pricing VIX and VVIX
中村 信弘(一橋大学大学院経営管理研究科)

2項分岐木を用いたアメリカン・オプション価格計算の新手法: 離散コサイン変換アプローチ
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))

スウィングクオントオプションの価格付けとヘッジ
山田 雄二(筑波大学ビジネスサイエンス系),
松本 拓史(金沢大学融合研究域融合科学系)

<次ページに続く>

15:30-17:00 機械学習 座長:足立 高德(東京都立大学大学院経営学研究科)

最尤推定法による量子回路ボラティリティモデルの推定

高石 哲弥(広島経済大学教養教育部)

Mean-Variance Efficient Reinforcement Learning

加藤 真大(東京大学総合文化研究科),

中川 慧(野村アセットマネジメント),

阿部 拳之(サイバーエージェント),

森村 哲郎(サイバーエージェント)

決算説明会に対する極性分析と株式投資戦略における極性指標の最適化

中塚 洋佑(野村証券),

水門 善之(野村証券)

17:15-18:15 株式市場 座長:室井 芳史(東北大学経済学研究科)

人工市場シミュレーションによる値幅制限とサーキットブレーカーの効果比較

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システム数理学科)

効率的市場仮説と混合反応プロセス

王 京穂(明治大学データアナリティクス研究所)

会場案内

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 正門まで下車徒歩3分



2023年7月10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