

JAFEE

2006

夏季大会 プログラム

8月3日(木)

8月4日(金)

於：早稲田大学 日本橋キャンパス ホール

日本金融・証券計量・工学学会

(The Japanese Association of Financial Econometrics and Engineering)

事務局

〒101-8439 東京都千代田区一ツ橋 2-1-2 学術総合センター8F

一橋大学大学院国際企業戦略研究科 金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp

8月3日(木)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:20 大会受付

9:50 -10:50 資産価格評価 座長:石井 昌宏(大東文化大学 経営学部)

償還条項付きロシアンオプションと最適行使境界について

鈴木 淳生(南山大学 数理情報学部),
澤木 勝茂(南山大学 数理情報学部)

A Real Estate Valuation Model under Regime Switching

石島 博(大阪大学 金融・保険教育研究センター),
谷山 智彦(株式会社 野村総合研究所)

11:00 -12:00 オプション理論を用いた経営戦略 座長:池田 昌幸(早稲田大学大学院 ファイナンス研究科)

Optimal Investment under Cost Uncertainty with Maintenance and Abandonment

高嶋 隆太(東京大学大学院 工学系研究科 原子力国際専攻),
高森 寛(早稲田大学大学院 ファイナンス研究科)

年金リスクと最適資本構成

川上 高志(株式会社 ニッセイ基礎研究所),
木島 正明(首都大学東京大学院 社会科学研究科/京都大学 経済学部 大和証券グループ寄附講座),
湯前 祥二(法政大学 経済学部 現代ビジネス学科)

12:00-13:00 昼休み, 理事会・評議員会

13:00-13:30 総会

13:40-14:40 会長講演

非完備市場におけるプライシング

高橋 一(一橋大学大学院 経済学研究科)

14:50 -16:20 リスク管理 座長:津田 博史(株式会社 ニッセイ基礎研究所)

多目的 GA を用いた信用リスクモデルの財務指標選択

山内 浩嗣(株式会社 三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC) 研究部)

A Method of Calculating the Downside Risk by Multivariate Nonnormal Distributions

永原 裕一(明治大学 政治経済学部)

多変量ハイブリッドプロセスとその応用

伊藤 保之(株式会社 東芝 電力システム社 電力・社会システム技術開発センター)

16:30 -17:30 ポートフォリオ分析の新展開 座長:大上 慎吾(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

A Bayesian Model Averaging Approach for Portfolio Selection

中妻 照雄(慶應義塾大学 経済学部)

The Robustness of Asset Pricing Models: Coskewness and Cokurtosis

安藤 雅和(日本学術振興会特別研究員(名古屋市立大学)),
程島 次郎(名古屋市立大学大学院 経済学研究科)

18:00-20:00 懇親会

8月4日(金)

報告時間 30分(質疑応答も含む)

9:30 大会受付

9:50 -10:50 コンピュータショナル・ファイナンス 座長: 枇々木 規雄(慶應義塾大学 理工学部)

PSA を応用したオンライントレードシステムのリスク評価
竹澤 伸久(株式会社 東芝), 中島 尚紀(株式会社 大和総研),
坪根 直毅(株式会社 大和総研), 中原 克彦(株式会社 東芝),
奥田 裕明(東芝ソリューション株式会社)

投資家の相互作用と市場のダイナミクス: マルチエージェント・シミュレーション
中里 宗敬(青山学院大学 国際マネジメント研究科),
清水 康司(青山学院大学 国際マネジメント研究科),
大島 正嗣(青山学院大学 国際マネジメント研究科)

11:00 -12:00 非完備市場における投資戦略 座長: 塚原 英敦(成城大学 経済学部)

Robust Utility Maximization in a Jump-Diffusion Factor Model
中村 信弘(一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

回収率が予測不可能な社債の効用無差別価格とリスクプレミアムについて
正田 智昭(株三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC)/一橋大学大学院 国際企業戦略研究科)

12:00-13:00 昼休み

13:00 -14:20 金融商品セッション: セッションテーマ『クレジット・デリバティブ』
司会: 廣中 純(野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社)

トランチド・インデックスについて(仮題)
大橋 英敏(モルガン・スタンレー証券株式会社 債券統括本部 債券調査本部長)

最近のシンセティック CDO 商品の動向について(仮題)
林 直哉(みずほ証券株式会社 市場営業グループ クレジットトレーディング部
ストラクチャードクレジットプロダクツ担当 課長)

14:30 -15:30 株式市場の実証分析 I 座長: 磯貝 明文(株式会社 三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

マルチ・ファクター・モデル20年 -なぜリスク管理が必要か-
鎌田 直人(MSCI Barra/モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・インク 東京支店)

OSE と SGX における日経平均先物の価格形成について
池田 義男(茨城大学 人文学部 社会科学科), 新村 昌寛

15:40 -16:40 株式市場の実証分析 II 座長: 山内 浩嗣(株式会社 三菱UFJトラスト投資工学研究所(MTEC))

12ヶ月モメンタム効果
石田 功(東京大学公共政策大学院/東京大学大学院 経済学研究科),
安達 哲也(新光証券株式会社 エクイティ部)

独自分類(K 分類)セグメントデータに基づく研究開発費が企業成長力と経営安定性に与える影響についての実証分析
笠井 康則(ロイター・ジャパン株式会社)

会場案内

早稲田大学 日本橋キャンパス ホール

東京都中央区日本橋1-4-1 コレド日本橋5F



<地下鉄をご利用の場合>

東京メトロ銀座線・東西線、都営地下鉄浅草線「日本橋」駅
出口直結(B12.C1.C2出口)

東京メトロ半蔵門線・銀座線「三越前」駅 徒歩3分

<JRをご利用の場合>

JR各線「東京」駅 徒歩6分

2006年6月30日発行

発行 日本金融・証券計量・工学学会(**JAFEE**)

制作 〒101-8439

東京都千代田区一ツ橋 2-1-2

学術総合センター8F

一橋大学大学院国際企業戦略研究科

金融戦略共同研究室

TEL 03-4212-3110

FAX 03-4212-3020

Email office@jafee.gr.jp JAFEE大会担当