

## 大阪大学 金融・保険教育研究センター 平成19年度 連携交流セミナー

日 時：2月23日（土） 10：30～

場 所：大阪大学 待兼山会館2階会議室

### 10：30～12：00（各15分）

上田 時由 基礎工学研究科 システム創成専攻数理科学領域 博士前期課程2年  
(10:30-10:45) 時系列モデルと極値モデルを用いた Value-at-Risk の比較

柴田 倫孝 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(10:45-11:00) HARA utility maximization for Levy type market models

鈴木 啓太 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(11:00-11:15) 境界付き分枝ランダム・ウォークの臨界値

田中 秀幸 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(11:15-11:30) A General Framework for Weak Approximations with an Application to Infinite Activity Levy Driven SDEs

中野 聡志 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(11:30-11:45) 局所ボラティリティを持つ LIBOR マーケットモデルに対する Dupire の公式

松島 純之介 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(11:45-12:00) Hidden Markov Model における因子分析と経済時系列への応用

### 12：00～13：00 昼休憩

### 13：00～13：45（各15分）

渡辺 有佑 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士前期課程2年  
(13:00-13:15) A CRITERION FOR ERGODICITY OF ELLIPTIC DIFFUSIONS WITH AN APPLICATION TO NONLINEAR FILTERING

中尾 堯 経済学研究科 経営学系専攻 博士前期課程2年  
(13:15-13:30) 楕円分布を仮定したリスクマネジメント  
ーリスクメジャー制約が投資家の行動に与える影響を中心としてー

栗山 寛 経済学研究科 経営学系専攻 博士前期課程2年  
(13:30-13:45) インフレ変動と人的資本を考慮した動的アセットアロケーション

13:45~14:00 休憩

**14:00~16:00 (各30分)**

三木 久史 理学研究科数学専攻 博士後期課程2年

(14:00-14:30) Van der Corput 列のランダムシフトに関する大数の強法則

瀧野 一洋 経済学研究科 経営学系専攻 博士後期課程3年

(14:30-15:00) ヘッジの難しいデリバティブの評価とヘッジ戦略について

安田 和弘 基礎工学研究科 システム創成専攻 博士後期課程3年

(15:00-15:30) Bayesian Inference under Discrete Observation and Unknown Transition Density

鍛冶 俊輔 理学研究科 数学専攻研究生

(15:30-16:00) Dupire の導出した公式の拡張

16:00~16:15 休憩

**16:15~17:15 (各30分)**

藤原 武弘 野村証券株式会社 金融工学研究センター デリバティブ・プロダクト・リサーチ・グループ

(16:15-16:45) TBA

森脇 成彦 株式会社三菱 UFJ トラスト投資工学研究所 研究部 研究員

(16:45-17:15) 幾何安定過程と MEMM を用いたオプション価格評価の実証分析結果について  
(仮題)

以上