

2011 年度中之島ワークショップ 金融工学・数理計量ファイナンスの諸問題 2011

主催：大阪大学金融・保険教育研究センター

期日：2011 年 12 月 2 日 (金)、3 日 (土)

会場：大阪大学中之島センター (参考 <http://www.onc.osaka-u.ac.jp/>)

謝辞：本ワークショップは「住友経営テクノロジー・フォーラム」からの財政的支援を受けております。

プログラム (2011 年 11 月 18 日現在)

12/2 午前 (会場：佐治敬三メモリアルホール)

9:20-9:30: opening

(午前 1) 座長：内田善彦 (日本銀行)

9:30-10:20: 木島正明 (首都大学東京)

Equilibrium Price and Allocation in the Presence of Transaction Costs
(joint work with C. Hara and A. Tamura)

(午前 2) 座長：関根順 (大阪大学)

10:30-11:00: 石谷謙介 (三菱 UFJ トラスト投資工学研究所)

Wavelet 変換を用いた信用リスクの解析的な評価方法：Multi-Factor Merton Model における高速計算法

11:00-11:30: 足立高德 (一橋大学)

Credit Risk Modeling with Delayed Information

11:30-12:00: 中川秀敏 (一橋大学)

On Surrender and Default Risk
(joint work with Olivier Le Courtois)

12/2 午後 (会場：佐治敬三メモリアルホール)

(午後 1) 座長：大屋幸輔 (大阪大学)

13:30-14:20: 林高樹 (慶応義塾大学)

高頻度データの取引価格とタイムスタンプ

14:30-15:20: 大森裕浩 (東京大学)

Realized Stochastic Volatility with Leverage and Long Memory
(joint work with Shinichiro Shirota and Takayuki Hizu)

15:20-15:50: コーヒーブレイク

(午後 2) 座長：内田雅之 (大阪大学)

15:50-16:40: 西山慶彦 (京都大学)

A Goodness of Fit Test for Ergodic Markov Processes
(joint work with Vance Martin and John Stachurski)

16:40-17:10: 藤井孝之 (大阪大学・JST CREST)

拡散過程の離散観測に基づく AIC 型情報量規準

(午後3) 座長：大西匡光 (大阪大学)

17:20-17:50: 本多俊毅 (一橋大学)

大域的分散最小ポートフォリオとポートフォリオ運用

17:50-18:20: マクリン謙一郎 (慶応義塾大学)

GPGPU Parallel Computing for Bayesian Portfolio Selection with a Massive Number of Assets
(joint work with Teruo Nakatsuma)

18:40- 懇親会 (会場：9F 交流サロン)

12/3 午前 (会場：佐治敬三メモリアルホール)

(午前1) 座長：関根順 (大阪大学)

9:00-9:50: 前田章 (東京大学)

環境エネルギーに対する市場ベースの政策手段 市場安全弁メカニズムを中心に

10:00-10:50: 森本祐司 (キャピタスコンサルティング)

保険数理と保険業界の課題について

(午前2) 座長：深澤正彰 (大阪大学)

11:00-11:30: 中村恒 (一橋大学)

A Continuous-Time Optimal Insurance Design with Costly Monitoring

11:30-12:00: 吉川大介 (みずほ第一フィナンシャルテクノロジー)

An Equilibrium Approach to Indifference Pricing and Utility-based Price.

12/3 昼 (会場：佐治敬三メモリアルホール)

12:10-12:30: 大阪大学金融・保険教育研究センター 教育プログラム説明会

12/3 午後 (会場：7F セミナー室)

(午後1) 座長：深澤正彰 (大阪大学)

13:30-14:00: 新原祐喜 (三菱東京 UFJ 銀行)

確率局所ボラティリティ・モデルの漸近展開を利用したバリア・オプションの静的ヘッジ

14:00-14:30: 藤井優成 (東京大学)

Pricing of Collateralized Derivatives

(joint work with Akihiko Takahashi)

(午後2) 座長：山崎和俊 (大阪大学)

14:40-15:10: 山崎輝 (みずほ第一フィナンシャルテクノロジー・東京大学)

Exponential Lévy Models Extended by a Jump-to-default

15:10-15:40: 菊池健太郎 (日本銀行)

ゼロ金利制約とファット・テイル性を考慮した金利分析：非負制約付き金利期間構造モデルの提案と実証分析

(午後3) 座長：西原理 (大阪大学)

15:50-16:20: 後藤順哉 (中央大学)

CVaR 最小化の脆弱性を軽減するためのロバスト・ポートフォリオ最適化
(篠崎桂太との共同研究)

16:20-16:50: 八木恭子 (秋田県立大学)

転換社債発行企業の経営者報酬と資本構成

(高嶋隆太との共同研究)

16:50-: closing