

大阪大学金融・保険教育研究センター（CSFI）主催 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 2013」

日程：平成25年12月5日（木）、12月6日（金）

会場：大阪大学 中之島センター

10階、佐治敬三メモリアルホール（196席）

〒530-0005 大阪市北区中之島4-3-53

電話：06-6444-2100 FAX：06-6444-2338

URL：<http://www.onc.osaka-u.ac.jp/>

※ なお、このワークショップは「住友経営テクノロジー・フォーラム」および「大阪大学未来研究イニシアティブ」事業の財政的支援を受けております。

プログラム

■ 12月5日（木）

★午前

[開会の辞] 9:50-10:00

大屋幸輔 CSFI センター長（大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI）

[セッション1] 10:00-12:00

座長：深澤正彰（大阪大学 大学院・理学研究科 & CSFI）

講演：

- 吉川大介（日本銀行 金融研究所），A Pricing Theory on Finite Number of Issued Securities
- 森本裕介（三菱東京 UFJ 銀行 市場企画部 & 東京大学 大学院・数理科学研究科），アメリカンモンテカルロ法における Re-Simulation の有効性と CVA 計算への応用
- 藤井優成（東京大学 大学院・経済学研究科），Making Mean-Variance Hedging Implementable

昼食&コーヒーブレイク 12:00-13:20

★午後

[セッション2]（未来研究イニシアティブ・セッション） 13:20-14:40

座長：高橋 慎（大阪大学 CSFI）

講演：

- 加藤賢悟（東京大学 大学院・経済学研究科），Gaussian Approximations and Multiplier Bootstrap for Maxima of Sums of High-Dimensional Random Vectors
- 沖本竜義（一橋大学 大学院・国際企業戦略研究科），Decreasing Trends in Stock-Bond Correlations

休憩&コーヒーブレイク 14:40-15:00

[セッション3：特別講演] (未来研究イニシアティブ・セッション) 15:00-16:00

座長：谷崎久志 (大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI)

講演：

- 刈屋武昭 (明治大学 専門職大学院・グローバル・ビジネス研究科 & 大学院・先端数理科学研究科), 国債価格の実証的モデリングで数理ファイナンスモデルは有効か！ —国債価格分析・金利分析実証モデル—

休憩&コーヒーブレイク 16:00-16:20

[セッション4] 16:20-17:40

座長：黒瀬雄大 (大阪大学 CSFI)

講演：

- 都築幸宏 (東京大学 大学院・経済学研究科), No-Arbitrage Bounds on Two One-Touch Options
- 斎藤大河 (東京大学 大学院・経済学研究科), Pricing Foreign Exchange Options under One-Sided Intervention by Absorption Modelling

[懇親会] (9階, 交流サロンにて) 18:00-

司会：関根 順 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

[一般参加者は会費 5,000 円]

■ 12月6日 (金)

★午前

[セッション1] (未来研究イニシアティブ・セッション) 9:40-11:40

座長：加藤 恭 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

講演：

- 渡邊有佑 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科), 最適投資・消費問題に現れる退化型 HJB 方程式の解析
- 加藤康之 (京都大学 大学院・経済学研究科), リスクベースポートフォリオと資産運用
- 廣中 純 (野村アセットマネジメント), バーゼルⅢ下におけるポートフォリオの信用リスク管理

昼食&コーヒーブレイク 11:40-13:00

★午後

[セッション2：特別講演] 13:00-14:00

座長：関根 順 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

講演：

- 江上雅彦 (京都大学 大学院・経済学研究科), An Excursion-Theoretic Approach to Financial Decisions

休憩&コーヒーブレイク 14:00-14:20

[セッション3] 14:20-16:20

座長: 西原 理 (大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI)

講演:

- 乾 孝治 (明治大学 大学院・先端数理科学研究科), ティック・デプスデータを用いた高速取引市場の取引コスト分析
- 山田俊皓 (三菱UFJトラスト投資工学研究所 & 東京大学 大学院・経済学研究科), Asymptotic Methods for Computational Finance
- 服部彰夫 (日本銀行 金融研究所), システミック・リスク指標に関するサーベイ —手法の整理とわが国への適用可能性—

休憩&コーヒーブレイク 16:20-16:40

[セッション4] 16:40-18:00

座長: 清水泰隆 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

講演:

- 塚原英敦 (成城大学 経済学部), Backtesting Distortion Risk Measures
- 林 高樹 (慶應義塾大学 大学院・経営管理研究科), 国内株式市場間の先行遅延関係分析

[閉会の辞] 18:00-18:10

内田雅之 CSFI 副センター長 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

以上