

2017 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 2017

大阪大学 数理・データ科学教育研究センター 金融・保険部門主催

日程：2017 年 11 月 30 日（木） - 12 月 1 日（金）

会場：大阪大学中之島センター 10F 佐治敬三ホール

### 11 月 30 日（木）午前

10:30-10:35 開会の辞 太田亘（大阪大学 MMDS 金融保険部門長）

セッション 1 [座長：Jeon, Haejun（大阪大学）]

10:40-11:20 山田哲也（日本銀行）

マイナス金利を考慮したフォワードレートモデルと市場の金利見通し

11:20-12:00 石島博（中央大学）

A Generalized Hedonic Pricing Model with Exogenous Variables

### 11 月 30 日（木）午後

セッション 2 [座長：西原理（大阪大学）]

13:30-14:30 [特別講演] 堀敬一（関西学院大学）

Debt Maturity, Default, and Investment under Rollover Risk and Solvency Concern

休憩

セッション 3 [座長：深澤正彰（大阪大学）]

15:00-15:40 室町幸雄（首都大学東京）

当初証拠金の時価評価（Initial Margin Valuation Adjustment）

15:40-16:20 前田純（University of Warwick）

トレーダーによるボラティリティモデル

16:20-17:00 水口啓（野村證券）

実務面から見た良いモデルとは

17:30-19:30 意見交換会

## 12月1日（金）午前

セッション4 [座長：大屋幸輔（大阪大学）]

10:00-10:40 内山朋規（首都大学東京）

危険なデータマイニング —リターン予測とオーバーフィッティング—

10:40-11:20 中川秀敏（一橋大学）

多次元 Hawkes 過程を用いたファイナンスのイベント・データの分析

~日本企業の倒産リスクの伝播構造推定の事例を中心に~

11:20-12:00 生方雅人（釧路公立大学）

Risk Premia Dynamics of the Japanese Financial Markets

## 12月1日（金）午後

セッション5 [座長：貝瀬秀裕（大阪大学）]

13:30-14:10 江口翔一（大阪大学）

エルゴード的拡散過程における時間スケールの推定

14:10-14:50 今井悠人（MTEC）

On the difference between locally risk-minimizing and delta hedging strategies  
for exponential Lévy models

休憩

セッション6 [座長：田口大（大阪大学）]

15:20-16:00 尾立唯生（首都大学東京）

A direct solution method for pricing options involving the maximum process

16:00-17:00 [特別講演] 赤堀次郎（立命館大学）

Stochastic Volatility Models of Quadratic Volterra Gaussian Type

17:00-17:05 閉会の辞 深澤正彰（2017年度中之島ワークショップ総合司会）

※ワークショップ開催中、受付近くのブースにて大阪大学 MMDS が提供する教育プログラムについての説明を行いますので、ご関心をお持ちの方は受付にてお申し出ください。