

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 2012」

日程：平成24年11月30日（金），12月1日（土）

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（192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/>

プログラム（10月23日（火）現在）

■ 11月30日（金）

午前

【開会の辞】 9:50-10:00

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））

【セッション1】 10:00-12:00

座長：山崎和俊（大阪大学 CSFI）

講演：

- 石島 博（中央大学 大学院・国際会計研究科），不動産の価格とリターンの評価モデルと応用
- 室井芳史（東北大学 大学院・経済学研究科），2項分岐モデルを用いたジャンプ拡散過程におけるグリークスの計算方法
- 梅澤祐二（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー），Pricing Path-Dependent Options with Discrete Monitoring under Time-Changed Lévy Processes

昼食&コーヒーブレイク 12:00-13:20

午後

【セッション2】 13:20-15:20

座長：清水泰隆（大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI）

講演：

- 荻原哲平（大阪大学 CSFI, JST CREST），高頻度観測データを用いた共分散推定法に関して
- 藤井孝之（大阪大学 CSFI, JST CREST），ジャンプマルコフ過程のノンパラメトリック推定
- 相原伸一（諏訪東京理科大学 システム工学部 機械システム工学科），Estimation and Identification of Stochastic Volatility

休憩&コーヒースタンド 15:20-15:50

[セッション3] 15:50-17:50

座長：加藤 恭（大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI）

講演：

- 尾張圭太（東京大学 大学院・経済学研究科），On Convex Risk Measures for Unbounded Risks
- 足立高德（一橋大学 大学院・国際企業戦略研究科），A Note on Categorical Risk Measure Theory
- 孕石匡弘（日本銀行金融研究所），CVAを考慮した逆問題の解法について

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）

■ 12月1日（土）

午前

[セッション1] 9:40-11:40

座長：西原 理（大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI）

講演：

- 西出勝正（横浜国立大学 大学院・国際社会科学研究科），Pricing of Discount Bonds with a Markov Switching Regime
- 高野祐一（東京工業大学 大学院・社会理工学研究科），非線形制御ポリシーを用いた動的ポートフォリオ最適化
- 森本裕介（三菱東京UFJ銀行 市場企画部 市場ソリューション室），アメリカン・モンテカルロ法における継続価値評価の精緻化

昼食&コーヒースタンド 11:40-13:00

午後

[セッション2：特別講演] 13:00-14:00

座長：深澤正彰（大阪大学 大学院・理学研究科 & CSFI）

講演：

- Arturo Kohatsu-Higa（立命館大学 大学院・理工学研究科），Recent Advances in Infinite Dimensional Analysis with Applications

[セッション3] 14:00-15:20

座長：貝瀬秀裕（大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI）

講演：

- 藤本一文（三菱東京UFJ銀行 総合リスク管理部），Expected Utility Maximization under Incomplete Information and with Cox-Process Observations
- 中野 張（東京工業大学 大学院・イノベーションマネジメント研究科），確率制御問題の数値解法について

休憩&コーヒーブレイク 15:20-15:40

[セッション3] 15:40-17:00

座長：石田 功（大阪大学 CSFI）

講演：

- 沖本竜義（一橋大学 大学院・国際企業戦略研究科）, Increasing Trends in the Excess Comovement of Commodity Prices
- 高見澤秀幸（一橋大学 大学院・商学研究科）, Impact of No-arbitrage on Interest Rate Dynamics

[閉会の辞] 17:00-

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

※ なお、

1. ワークショップ開催中、受付近くにブースを設けて、大阪大学においてCSFI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、御関心をお持ちの方は受付にてお申し出下さい；
2. 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」の財政的支援を受けております。

以上