

大阪大学 数理・データ科学教育研究センター (MMDS)

金融・保険部門主催・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 2015」

日程: 平成 27 年 12 月 3 日 (木), 12 月 4 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「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 3 日 (木) 午前

[開会の辞] 9:55-10:00

太田亘 (大阪大学大学院経済学研究科 & MMDS)

[セッション 1] (未来研究イニシアティブ・セッション)10:00-12:00

座長 高橋慎 (大阪大学大学院経済学研究科 & MMDS)

講演:

山田哲也 (日本銀行金融研究所)

「月次クレジットサイクルの推計：日本経済とイールドカーブへの応用」

石田功 (甲南大学経済学部)

「関数自己回帰モデルによるイントラデイ・ボラティリティの実証分析」

山本竜市 (早稲田大学政治経済学部)

“Does high-frequency trading improve market quality?”

昼食&コーヒーブレイク 12:00-13:30

12 月 3 日 (木) 午後

[セッション 2: 特別講演]13:30-14:30

座長 太田亘 (大阪大学大学院経済学研究科 & MMDS)

講演:

田中敬一 (首都大学東京大学院社会科学研究所)

“Optimal timing for short-covering”

休憩&コーヒーブレイク 14:30-15:00

[セッション 3] 15:00-17:00

座長 太田 亘 (大阪大学大学院経済学研究科 & MMDS)

講演:

清水克俊 (名古屋大学大学院経済学研究科)

“Systemic risk and crisis management during Japanese financial crisis: A CoVaR approach”

小林照義 (神戸大学大学院経済学研究科)

“Cascades in multiplex financial networks with debts of different seniority”

鈴木輝好 (北海道大学大学院経済学研究科)

“The Pricing Model of Credit Default Swaps under Systemic Risk”

懇親会 (9 階, 交流サロンにて) 17:30-19:30

12 月 4 日 (金) 午前

[セッション 4] 10:00-12:00

座長 深澤 正彰 (大阪大学大学院理学研究科 & MMDS)

講演:

荻原哲平 (統計数理研究所)

「非同期・ノイズ付観測された拡散過程に対する最尤型・ベイズ型推定法」

小池祐太 (統計数理研究所)

「連続時間モデルによる価格発見の統計解析」

長倉大輔 (慶應義塾大学経済学部)

“Estimating and Forecasting the Integrated Variance by Its Linear Projection on the Squares of High Frequency Returns”

昼食&コーヒーブレイク 12:00-13:30

12 月 4 日 (金) 午後

[セッション 5: 特別講演] (未来研究イニシアティブ・セッション) 13:30-14:30

座長 関根 順 (大阪大学大学院基礎工学研究科 & MMDS)

講演:

池森俊文 (一橋大学大学院商学研究科)

「銀行の経営管理を合理的・統一的に構成する枠組み」

休憩&コーヒーブレイク 14:30-15:00

[セッション 6] 15:00-17:00

座長 石原庸博 (大阪大学 MMDS)

講演:

中津智則 (立命館大学理工学研究科)

「エキゾチックオプションに関する感応度及び密度関数について」

石谷謙介 (名城大学理工学部)

「バリア・オプションの感応度とパス空間における部分積分公式」

畑宏明 (静岡大学教育学部)

“Risk-sensitive asset management with general factor models”

[閉会の辞] 17:00-17:05

谷崎 久志 MMDS 金融・保険部門長 (大阪大学大学院経済学研究科 & MMDS)

※ 時間: 一般講演 30 分, 特別講演 50 分 (質疑応答は共に 10 分)

※ なお、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 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、御関心をお持ちの方は受付にてお申し出下さい。以上