

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」

日時 2006年12月7日(木)～8日(金)
場所 大阪大学中之島センター7F講義室2
主催 大阪大学金融・保険教育研究センター

プログラム

12月7日(木)

9:25 – 9:30	アナウンス
9:30 – 10:10	木村 俊一 (北海道大学) Valuing continuous-installment options via Laplace transforms: European vs. American
10:10 – 10:50	吉羽 要直 (日本銀行) 1 期間構造型モデルでの EaD、LGD、PD と期待・非期待損失の関係
11:00 – 11:30	梅澤 祐二 (東京大学) 多期間リスク尺度とヘッジング
11:30 – 12:00	藤森 征也 (三井住友銀行) 流動性預金の価値評価とリスク管理
13:00 – 13:30	中川 秀敏 (東京工業大学) RMBS のプライシング・モデル
13:30 – 14:00	室井 芳史 (大阪大学) ハザードの相関を考慮した信用派生商品の評価法
14:00 – 14:30	藤原 武弘 (野村証券) 楠岡近似の拡張とその応用について
14:50 – 15:50	楠岡 成雄 (東京大学) ファイナンスと数値解析
16:00 – 17:00	Kohatsu-Higa, Arturo (大阪大学) 数値計算ソフトウェア「Premia」の紹介
17:30 –	懇親会 (於: 大阪大学中之島センター9階交流サロン)

12月8日(木)

9:30 – 10:10	田中 周二 (日本大学) 保険数理と金融工学の接点
10:10 – 10:50	内田 雅之 (九州大学) 拡散過程の統計的モデル選択
11:00 – 11:30	清水 泰隆 (大阪大学) Statistical inference for diffusion processes with jumps from sampled data
11:30 – 12:00	安田 和弘 (大阪大学) Malliavin 解析を用いた多次元確率密度関数の推定とその応用
13:00 – 13:30	川口 宗紀 (三菱 UFJ トラスト投資工学研究所) 格付けを用いた信用リスク評価モデル
13:30 – 14:00	箆島 靖文 (三菱 UFJ 証券) The Implied Volatility for Dynamic SABR Model and FX Hybrid Model
14:00 – 14:30	中野 張 (大阪大学) リスク尺度による価格付けについて
14:50 – 15:50	関根 順 (京都大学) 長期間最適ポートフォリオの計算について
16:00 – 17:00	長井 英生 (大阪大学) フィルタリング・確率制御と動的最適化