

大阪大学金融保険教育研究センター・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：12月1日(土)~12月2日(日)

場所：大阪大学中之島センター7階講義室2

プログラム

12月1日(土) 第1日目

9:55---10:00 開会の辞

10:00---11:30 座長：国友直人 氏（東京大学・大阪大学 CSFI 寄附研究部門）

10:00 - 10:30 太田 亘 氏（大阪大学）
指値注文市場におけるスプレッド

10:30 - 11:00 森本孝之 氏（一橋大学）
ランダム行列による高頻度金融データの解析
（橋完太氏との共同研究）

11:00 - 11:30 生方雅人 氏（大阪大学）
Bias Correct Cumulative Covariance Estimator のパラメータの選択法について

11:30 --- 13:00 昼食

日本オペレーションズ・リサーチ学会「ファイナンスと意思決定」研究部会との共催セッション

13:00 --- 14:30 座長：田中敬一 氏（首都大学東京）

13:00 - 13:30 江上雅彦 氏（京都大学）
On the One-dimensional Optimal Switching Problem

13:30 - 14:00 西原 理 氏（大阪大学 CSFI）
非対称情報下のリアルオプション

14:00 - 14:30 竹原浩太 氏（東京大学）
An Asymptotic Expansion Approach to Pricing Long-term Currency Options

14:30 --- 14:45 休憩

14:45 --- 16:15 座長：大屋幸輔 氏（大阪大学）

14:45 - 15:15 Nabil MAGHREBI 氏（和歌山大学）
The Stochastic Behavior of the Nikkei 225 Implied Volatility Index
(joint work with Kazuhiko Nishina and Moo Sung Kim)

15:15 - 15:45 杉原慶彦 氏 (日本銀行)
わが国株式市場のモデル・フリー・インプライド・ボラティリティ

15:45 - 16:15 箆島靖文 氏 (BNP パリバ証券)
General Asymptotics of Wiener Functionals
and Application to Mathematical Finance

16:15 --- 16:30 休憩

16:30 --- 18:30 座長：内田善彦 氏 (日本銀行)

16:30 - 17:00 室町幸雄 氏 (ニッセイ基礎研究所)
信用リスクを考慮したときの集中リスク分析 - VaRとESの各資産への分解 -

17:00 - 17:30 内山朋規 氏 (野村証券)
物価連動債が経済の均衡に与える影響

17:30 - 18:00 藤原 哉 氏 (野村証券)
経路依存型アメリカン・オプションのプライシング

18:00 - 18:30 藤田岳彦 氏 (一橋大学)
On Pricing "Meander Option"

18:30 - (19:00 開始) 懇親会 (中之島センター 9階交流サロン)

12月2日(日) 第2日目

10:00---11:00 座長：清水泰隆 氏 (大阪大学)

10:00 - 10:30 内田雅之 氏 (大阪大学)
Estimation for Discretely Observed Ergodic Diffusions under Incorrect Models

10:30 - 11:00 増田弘毅 氏(九州大学)
On the Use of Long-term Multipower Variations in Estimation Problem

11:00 --- 11:10 休憩

11:10---12:10 座長：増田弘毅 氏(九州大学)

11:10 - 11:40 清水泰隆 氏 (大阪大学)
Detection of Jumps for Simple Jump-Diffusions from Finite Samples

11:40 - 12:10 室井芳史 氏 (大阪大学 CSFI 寄附研究部門)
Pricing Double Barrier Options with Fast Mean-Reverting Stochastic Volatility

12:10 --- 13:10 昼食

13:10---14:10 座長：Kohatsu-Higa, Arturo 氏(大阪大学)

13:10 - 13:40 中山季之 氏 (三菱 UFJ 証券)

金利モデルの整合性問題の紹介

13:40 - 14:10 河合玲一郎 氏 (大阪大学 CSFI)

Some Applications of Stochastic Approximation Algorithms
to Monte Carlo Variance Reduction

14:10 --- 14:20 休憩

14:20---15:20 座長：河合玲一郎 氏 (大阪大学 CSFI)

14:20 - 14:50 畑 宏明 氏 (Academia Sinica, Taiwan)

Asymptotics of the Probability Minimizing a "Down-side" Risk
(joint work with Hideo Nagai and Shuenn-Jyi Sheu)

14:50 - 15:20 横谷進弥 氏 (みずほ証券)

CDO プライシングの高速化手法

15:20 --- 15:30 休憩

特別セッション 1

15:30---16:30 座長：内田雅之 氏 (大阪大学)

15:30 - 16:30 吉田朋広 氏 (東京大学)

Nonsynchronous Covariance Estimation and Limit Theorems

16:30 --- 16:40 休憩

特別セッション 2

16:40---17:40 座長：長井英生 氏 (大阪大学)

16:40 - 17:40 Marek Rutkowski 氏 (University of New South Wales, Australia)

Convertible Bonds with Credit Risk

17 : 40---17:45 開会の辞