

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 2008」

日程：平成20年12月 6日 (土), 7日 (日)

会場：大阪大学 中之島センター, 7階, セミナー室 (102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/>

参加費：無料 (予約の必要はございません。)

なお、6日 (土) の全講演終了後下記の要領で懇親会を開催致しますので、奮って御参加頂きますよう、御案内申し上げます。

懇親会

日時：12月 6日 (土), 午後6時30分～

会場：大阪大学 中之島センター, 10階メモリアルホール

<http://www.onc.osaka-u.ac.jp/reservation/outline/floor/index10.html>

会費：一般参加者6,000円

当日シンポジウム会場受付にて頂戴致します。なお、準備の都合上、参加を希望される方は、12月1日 (月) までに、CSFI 事務 <csfi-jim@sigmath.es.osaka-u.ac.jp> 宛てに御連絡下さい。

プログラム (11月25日 (火) 現在)

■ 12月 6日 (土)

午前

【開会の辞】 9:30-9:40

長井英生 氏 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

【セッション1】 9:40-12:10

座長：西原 理 氏 (大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI)

講演：

- 鈴木輝好 氏 (北海道大学 大学院・経済学研究科)
The Optimal Capital Structure and Endogenous Bankruptcy for a Fixed Term Debt Issued at Par
- 田 園 氏 (京都大学 大学院・経済学研究科)
Compensation Measures for Alliance Formation: A Real Options Analysis

- 芝田隆志 氏 (首都大学東京, 大学院・社会科学研究科)
Dynamic Investment and Corporate Structure under Manager-Shareholder Conflicts
- 田中敬一 氏 (首都大学東京, 大学院・社会科学研究科)
Dynamic Asset Allocation under Stochastic Interest Rate and Market Price of Risk

昼食 12:10-13:30

午後

[セッション2] 13:30-15:15

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

座長: 田中敬一 氏 (首都大学東京, 大学院・社会科学研究科)

講演:

- 山田雄二 氏 (筑波大学 大学院・ビジネス科学研究科)
Optimal Hedging Using Additive Models
- 新井拓児 氏 (慶應義塾大学 経済学部)
Good Deal Bounds Induced by Shortfall Risk
- 赤堀次郎 氏 (立命館大学 理工学部)
Constructing Interest Rate Models with Jumps by Heat Kernel Approach

休憩

[セッション3] 15:40-18:10

座長: 室井芳史 氏 (大阪大学 CSFI),

講演:

- 石田 功 氏 (東京大学 大学院・経済学研究科 & 公共政策大学院)
日経平均先物実現ボラティリティの予測: ジャンプ、レバレッジ、米国市場からのスピルオーバー効果
- 高見澤秀幸 氏 (筑波大学 大学院・人文社会科学研究科)
Interest Rate Volatility Implicit in Term Structure Data
- 塚原英敦 氏 (成城大学 経済学部)
Comparative Analysis of VaR and Some Distortion Risk Measure
- 山田哲也 氏 (日本銀行 金融研究所)
「メイン寄せ」リスクと貸出債権価値の評価: ゲーム論的リアルオプションによるアプローチ

懇親会 (10階メモリアル・ホールにて) 18:30-

司会: 大屋幸輔 氏 (大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI)

■ 12月 7日 (日)

午前

[セッション1] 9:40-11:25

座長: 長井英生 氏 (大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI)

講演：

- 高岡浩一郎 氏（一橋大学 大学院・商学研究科）
The Instantaneous Volatility and the Implied Volatility Surface for a Generalized Black-Scholes Model
- 藤田岳彦 氏（一橋大学 大学院・商学研究科 & 京都大学 数理解析研究所 寄附研究数理解析部門）
Pricing Put and Call Options on a Simple Stochastic Volatility Model
- 加藤 恭 氏（東京大学 大学院・数理科学研究科）
Optimal Execution Problem with Random Market Impact

昼食 11:25-13:00

午後

[セッション2] 13:00-14:10

座長：大西匡光 氏（大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI）

講演：

- 桜井悠司 氏
The Application of SABR Formula to the Pricing of Option on Realized Variance
- 石島 博 氏（中央大学 大学院・国際会計研究科）
レジーム・スイッチング因子分析とその応用

休憩

[セッション3] 14:25-16:10

● **座長：**内田雅之 氏（大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI）

講演：

- 今井潤一 氏（慶應義塾大学 理工学部）
An Enhanced Quasi-Monte Carlo Method for Simulating Lévy Process
- 竹内敦司 氏（大阪市立大学 大学院・理学研究科）
Sensitivity Analysis for Asset Price Dynamics with Gamma Processes
- 二宮祥一 氏（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 & 理財工学研究センター (GRAFT)）
Kusuoka Scheme: A New Weak Approximation Method of Diffusion Processes

休憩

[セッション4] 16:25-18:10

座長：深澤正彰 氏（大阪大学 CSFI）

講演：

- 内田雅之 氏（大阪大学 大学院・基礎工学研究科 & CSFI）
Estimation for Misspecified Diffusion Processes and its Application to Model Selection
- 増田弘毅 氏（九州大学 数理学研究院）
Simple Test for the Variation of a Discretely Observed Process: Long-Term Asymptotics
- 深澤正彰 氏（大阪大学 CSFI）
On the Validity of a Singular Perturbation Expansion of the Implied Volatility

【閉会の辞】 18:10-18:15

大西匡光 氏（大阪大学 大学院・経済学研究科 & CSFI 副センター長）

※ なお、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