

# 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 2014」

日程：平成26年12月4日(木)，12月5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4日(木)

#### 午前

#### 【開会の辞】 9:55~10:00

内田 雅之 CSFI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：深澤 正彰 (大阪大学大学院理学研究科 & CSFI)

講演：

□ 新井 拓児 (慶應義塾大学経済学部)

“Numerical analysis on local risk-minimization for exponential Levy models”

□ 山崎 輝 (法政大学経営学部)

“Lucas Trees with Exponential Utility”

□ 安田 和弘 (法政大学理工学部)

「為替レートに対する連続制御と制限をおいた確率インパルス制御について」

昼食&コーヒーブレイク 12:00~13:30

## 午後

### 【セッション2：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：谷崎 久志 (大阪大学大学院経済学研究科 & CSFI)

講演：

- 森平 爽一郎 (早稲田大学大学院ファイナンス研究科)  
「大災害のリスクファイナンス」

### 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 & CSFI)

講演：

- 大野 忠士 (筑波大学ビジネスサイエンス系)  
「流動性危機確率予測モデル」
- 菅野 正泰 (神奈川大学経営学部)  
“Assessing Systemic Risk using Interbank Exposures in the Global Banking System”
- 安達 哲也 (日本銀行金融研究所)  
「誤方向リスク管理と資産価格急落の関係について」

### 懇親会（9階，交流サロンにて） 17:30～

## ■ 12月5日（金）

### 午前

### 【セッション4】（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 CSFI)

講演：

- 生方 雅人 (釧路公立大学経済学部)  
“Evaluating the performance of futures hedging using multivariate realized volatility”
- 黒瀬 雄大 (関西学院大学理工学部)  
“Dynamic equicorrelation, realized stochastic volatility and cross leverage”
- 廣中 純 (野村アセットマネジメント)  
「日本のクレジット市場における信用リスク変動要因の検証」

### 昼食&コーヒーブレイク 12:00～13:30

## 午後

### 【セッション5：特別講演】 13:30～14:30

座長：関根 順 (大阪大学大学院基礎工学研究科 & CSFI)

講演：

- 高岡 浩一郎 (一橋大学大学院商学研究科)  
「数理ファイナンスの基本定理について」

## 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：加藤 恭 (大阪大学大学院基礎工学研究科 & CSFI)

講演：

- 久保 裕介 (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)  
「Hestonモデル下に於けるAsianオプションに対するある変数変換について」
- 田代 雄介 (三菱UFJトラスト投資工学研究所 (MTEC))  
「株式運用におけるトレーディング - 機関投資家の視点から -」
- 足立 高德 (立命館大学理工学部)  
「高頻度取引の実際」

### 【閉会の辞】 17:00～17:05

谷崎 久志 CSFI副センター長 (大阪大学大学院経済学研究科 & CSFI)

※ 報告時間： 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。

以上