

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 2016」

日程:平成 28 年 12 月 1 日(木), 2 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/>

プログラム

12 月 1 日(木)午前

【開会の辞】 10:30-10:35

竹内 恵行 (大阪大学大学院経済学研究科&MMDS)

【セッション 1】 10:35-11:55

座長: 西原 理 (大阪大学大学院経済学研究科&MMDS)

講演:

□ジョン ヘジュン (Haejun Jeon) (大阪大学 MMDS)

“Optimal Patent Policy in the Presence of Vertical Separation”(西原理との共同研究)

□山崎 和俊 (関西大学システム理工学部)

「パリジャン反射と保険・信用リスクへの応用」(Florin Avram, Jose Luis Perez との共同研究)

昼食&コーヒーブレイク 11:55-13:30

12 月 1 日(木)午後

【セッション 2:特別講演】 13:30-14:30

座長: 竹内 恵行 (大阪大学大学院経済学研究科&MMDS)

講演:

□小暮 厚之 (慶應義塾大学総合政策学部)

「長寿リスクのモデリングと評価—ベイジアン・プライシング—」

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：深澤 正彰（大阪大学大学院基礎工学研究科&MMDS）

講演：

□森本 裕介（三菱東京 UFJ 銀行）

“Algebraic Structure of Vector Fields of Financial Diffusion Models and Applications to KLVN method”

□篠崎 裕司（東京工業大学）

「高次楠岡近似の実現とファイナンスへの応用」

□田 園（Yuan Tian）（龍谷大学経済学部）

“Debt Rollover, Bankruptcy, and Debt Maturity”

**懇親会(9階, 交流サロンにて) 17:30-19:30**

**12月2日(金)午前**

**[セッション 4] 10:00-12:00**

座長：ジョン ヘジューン（大阪大学 MMDS）

講演：

□白谷 健一郎（東京大学大学院経済学研究科）

“An Approximation Method for Pricing Multi-asset Options”

□舟橋 秀治（みずほ証券）

“Analytical Pricing of Single Barrier Options under Local Volatility Models”（木島正明との共同研究）

□今村 悠里（東京理科大学経営学部）

“Asymptotic Static Hedge via Symmetrization”（赤堀次郎, Flavia Barsotti との共同研究）

**昼食&コーヒーブレイク 12:00-13:30**

**12月2日(金)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&MMDS）

講演：

□箆島 靖文（ゴールドマンサックス証券 証券部門 金融商品ストラテジスト部）

“Analytic and Asymptotic Methods of SABR Model”

**休憩&コーヒーブレイク 14:30-14:50**

**[セッション 6] 14:50-16:50**

座長： 太田 亘（大阪大学大学院経済学研究科&MMDS）

講演：

□ 國方 明（青森公立大学経営経済学部）

「新規参入行の金利リスク管理: デュレーションと金融派生商品利用」

□ 北島 孝博（大阪市立大学大学院経営学研究科）

「ノンパラメトリック確率密度推計によるNYSE Openbook 売手/買手別指値注文パターンの非対称性分析」(高田輝子との共同研究)

□ 小林 武(名古屋商科大学経済学部)

「本邦社債スプレッドの期間構造とマクロ経済」

**[閉会の辞] 16:50-16:55**

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）

※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 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，ご関心をお持ちの方は受付にてお申し出ください。

以上