



統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター

第2回 金融シンポジウム

「ファイナンスリスクのモデリングと制御」

事前登録不要・参加費無料

日時：2013年11月5日（火） 13:00～17:00
11月6日（水） 10:00～17:00

場所：学術総合センター 中会議場（2F）

交通アクセス

半蔵門線 三田線 新宿線「神保町」A9 出口 徒歩5分
(A8 出口は閉鎖中です)

東西線「竹橋」1b 出口 徒歩5分



【問い合わせ先】

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長 山下智志
(yamasita@ism.ac.jp)

シンポジウム開催事務局 内田早恵 (suchida@ism.ac.jp)



= プログラム =

11月5日 (火)

12:30~13:00 受付

13:00~13:05 開会のご挨拶

山下智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長)

第1セッション 「信用リスクデータベース分析の新技术」

座長：逸見昌之 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター)

13:05~13:35 山下智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター)

高橋淳一 (CRD 協会)

「大規模信用データベースにおける欠損値 (シングル) 補完の方法論と実例」

13:35~14:10 宮本道子 (秋田県立大学 システム科学技術学部)

「中小企業大規模財務データベースの分布を考慮した欠測 (マルチ) 処理」

14:10~14:45 今喜典 (青森公立大学 経営経済学部)

「地域金融機関の業種別貸出と金融機関リスク」

第2セッション 「時間と分布に関する数理ファイナンス」

座長：西山陽一 (統計数理研究所 数理・推論研究系)

15:00~15:35 川崎能典 (統計数理研究所 モデリング研究系)

吉田靖 (東京経済大学)

「先物市場の高頻度データに基づく立会時間延長の影響分析」

15:35~16:10 福元健太郎 (学習院大学 法学部)

「Trigonometric Copulas」

16:10~16:45 佃康司 (総合研究大学院大学)

「変化点問題に対する l^∞ および L^2 空間の Z-process 法」



11月6日(水)

9:30~10:00 受付

第3セッション 「確率論的リスク評価」

座長：三浦良造（一橋大学 国際企業戦略研究科）

10:00~10:35 清水泰隆（大阪大学大学院 基礎工学研究科）

「On a generalization from ruin to default in Levy insurance risks」

10:35~11:10 塚原英敦（成城大学 経済学部）

「Backtesting Distortion Risk Measures」

11:10~11:45 吉田朋広（東京大学大学院 数理科学研究科）

「Statistics for volatility: change point, model selection, and lead-lag」

{11:45~13:00 昼食}

第4セッション 「金融機関におけるリスク計量化の諸問題」

座長：山下智志（統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター）

13:00~13:35 吉羽要直（日本銀行 金融高度化センター）

「銀行勘定の金利リスクとコア預金モデル」

13:35~14:10 日野孝俊（三井住友銀行 企業調査部）

「銀行における信用リスク管理の概要」

14:10~14:45 細野健二、大重斉（国際協力銀行 外国審査部）

「ソブリンリスクの特性と評価：審査の実例を中心に」

第5セッション 「与信と投資のフロンティア」

座長：川崎能典（統計数理研究所 モデリング研究系）

15:00~15:35 大野忠士（筑波大学 ビジネスサイエンス系）

「フィナンシャルストレスの予測モデル」



15 : 35 ~ 16 : 10 津田博史 (同志社大学 理工学部)
 「地方自治体の信用リスク評価」

16 : 10 ~ 16 : 45 沖本竜義 (一橋大学 国際企業戦略研究科)
 「アジア 株式市場の関連性」

16 : 45 ~ 16 : 50 諸連絡と閉会挨拶

このシンポジウムは統計数理研究所 共同利用重点研究「ファイナンスリスクのモデリングと制御」からの助成を受けています。

入館時のご注意

開催場所の学術情報センターでは入館時にチェックがありますが、この案内をご呈示いただくことにより入館できます。入館後に会場前の受付にてあらためて入館証を発行します。

定量的リスク科学のネットワーク上での創生

