



統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター

第3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 II」

事前登録不要・参加費無料

日時：2014年11月25日（火） 13:30～17:55
11月26日（水） 10:00～17:50

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
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、050-5533-8564)

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25日 (火)

13:00～13:30 受付

13:30～13:40 開会挨拶

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 市場リスクとマーケット構造解析の新技术

座長：荻原哲平 (統計数理研究所)

13:40～14:20 深澤正彰 (大阪大学大学院理学研究科 准教授)
「流動性リスクの下でのヘッジ・効用無差別原理によるモデリング」

14:20～15:00 足立高德 (立命館大学 客員教授)
「高頻度取引の実際」

15:00～15:40 川崎能典 (統計数理研究所 准教授)
「点過程強度の安定性検証とその応用」

(休憩 15分)

第2セッション 信用リスクと公的年金の実務的リスク管理

座長：山下智志 (統計数理研究所)

15:55～16:35 北達伊佐雄 (三井住友銀行 ホールセール部門副責任役員)
「債務者格付と信用リスク管理」

16:35～17:15 清水信広 (厚生労働省年金局 首席年金数理官)
「年金数理の立場から見た公的年金のリスク管理」

17:15～17:55 平澤英司 (金融工学研究所 常務取締役)
「非財務情報を用いた倒産予測～適時開示情報の活用～」



11月26日(水)

9:30~10:00 受付

第3セッション ファイナンスモデルとリスク評価尺度

座長：吉羽要直（日本銀行金融研究所）

10:00~10:40 萩原哲平（統計数理研究所 助教）

「高頻度観測株価データに対する最尤型推定法」

10:40~11:20 塚原英敦（成城大学経済学部 教授）

「On backtesting risk measurement models」

11:20~12:00 中川秀敏（一橋大学大学院国際企業戦略研究科 准教授）

「Binary quantile regression を用いたデフォルト予測モデル構築：サーベイと応用」

{12:00~13:30 昼食}

第4セッション 実用的リスク計量化モデル構築の試み

座長：西山陽一（統計数理研究所）

13:30~14:10 森本孝之（関西学院大学理工学部 准教授）

「時系列トピックモデルを用いた金融市場のボラティリティ予測」

14:10~14:50 三浦良造（一橋大学名誉教授 東北大学客員教授）

柳澤健太郎（日本リスク・データ・バンク シニア・マネージャー）

「オペレーショナルリスク計測の統計モデルの現状」

14:50~15:30 山下智志（統計数理研究所 教授）

「担保保証情報を利用した PD・回収率・EL 計量化と保全セグメント」

(15分休憩)



第5セッション 複合的な現象に対する実務的リスク管理

座長：三浦良造（一橋大学、東北大学）

15:45～16:25 井川孝之（あらた監査法人 年金数理人）

「各国の長寿リスクの分散の探索」

16:25～17:05 吉羽要直（日本銀行金融研究所 ファイナンス研究グループ長）

「ストレス状況を勘案したコンピュータの金融実務での活用」

17:05～17:45 和合谷與志雄（新日本有限責任監査法人 プリンシパル）

「金融規制の銀行経営管理への活用」

閉会挨拶・ご連絡

17:45～17:50 山下智志 統計数理研究所

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

