



統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター

第5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 IV」

事前登録不要・参加費無料

日時：2017年12月14日（木） 13:30～17:55

12月15日（金） 10:00～17:55

場所：フクラシア丸の内オアゾ（丸の内北口ビルディング 15F）

交通アクセス（最後尾に詳細な案内あり）

JR「東京」駅 丸の内北口 目の前

丸の内線東京駅直結 東西線大手町駅直結



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[at]ism.ac.jp)

シンポジウム開催事務局 長幡 英明 (nagahata[at]ism.ac.jp)

=プログラム=

12月14日(木)

- 13:00~13:30 受付
- 13:30~13:35 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 銀行経営の現状・課題と会計・監査

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長)

- 13:35~14:25 吉野直行 (※) (アジア開発銀行研究所所長、金融庁金融研究センター長)
「FinTech のアジアでの成長と日本の金融業」
※ 本講演は講演者都合によりビデオ上映となります。
- 14:25~15:05 中村亮介 (筑波大学ビジネスサイエンス系 准教授)
「財務制限条項の実態・影響・役割」
- 15:05~15:45 吉藤茂 (三菱東京UFJ銀行 MUFG 執行役常務 グループ CAO)
「RAF と 3 線防御体制」

=コーヒーブレイク 10分=

第2セッション 金融リスクのモデリングと最適化

座長：吉田靖 (東京経済大学経営学部 教授)

- 15:55~16:35 国友直人 (明治大学政治経済学部 特任教授)
「点過程と統計的金融リスク分析」
- 16:35~17:15 枇々木規雄 (慶應義塾大学理工学部 教授)
「下方リスクを考慮した多期間最適執行戦略」
- 17:15~17:55 川崎能典 (統計数理研究所 教授)
「Quarticity を考慮した経験類似度に基づくボラティリティ予測」

12月15日(金)

- 9:30~10:00 受付

第3セッション 点過程による金融時系列モデリング

座長：荻原哲平 (統計数理研究所 助教)

- 10:00～10:40 中川秀敏（一橋大学大学院国際企業戦略研究科 准教授）
「Hawkes グラフによる倒産リスクの伝播構造の推定」
- 10:40～11:20 田代雄介（三菱 UFJ トラスト投資工学研究所）
「多次元 Hawkes 過程を用いた株式市場の注文反応分析」
- 11:20～12:00 近江崇宏（東京大学生産技術研究所 特任助教）
「点過程モデリングを用いた高頻度金融データへのアプローチ」

{12:00～13:30 昼食}

第4セッション 信用リスク評価に向けての数理技術のフロンティア

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長）

- 13:30～14:10 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）
「実務的信用リスク評価モデルの潮流：人工知能とデータ構造化について」
- 14:10～14:50 吉野一慶（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）
「一般化線形モデルにおける効率的な変数選択手法」
- 14:50～15:30 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）
「クレジット・デフォルト・スワップの信用評価調整：確率的強度と接合関数を用いた評価を中心に」

=コーヒーブレイク 15分=

第5セッション 保険リスクの計量化と応用

座長：川崎能典（統計数理研究所 教授）

- 15:45～16:25 野村俊一（統計数理研究所 助教）
「保険料率算定におけるスパース推定技法の活用」
- 16:25～17:05 井川孝之（PwC あらた有限責任監査法人 年金ディレクター）
「死亡リスクと金融リスクの相関を考慮した保険・年金負債分析」
- 17:05～17:45 清水泰隆（早稲田大学理工学術院 教授）
「リスク尺度に基づく変額年金の負債評価と中心極限定理」

閉会挨拶・事務連絡

- 17:45～17:55
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

FUKURACIA 丸の内オアゾ (丸の内北口ビル) 道のり案内

(JR東京駅方面より*地上からのアクセス)



東京駅「丸の内北口」改札方面へお進みください



改札を出て、「大手町方面」へ進み、外へ出ます



横断歩道の先、右手奥に「OAZO」と表示が出たビルが見えます



OAZO建物内へ入り、右手側に丸善（本屋さん）を見ながら進みます



丸善を過ぎると、右手側に「丸の内北口ビル」へ通じる自動ドアがございますので建物内へお進みください



すぐにエレベーターホールがございますので、【c】のエレベーターをご利用の上、15階（受付）へお進みください

(地下鉄丸ノ内線東京駅方面より*地下からのアクセス)



大手町・丸の内北口・八重洲方面、「丸の内オアゾ」へお進みください



「OAZO」の表示がでた自動ドアを入れて下さい



そのまま直進してください
※エスカレーターは利用しません



左側に「神戸屋（パン屋さん）」が見えてきます



少し進むと、右側に「丸の内北口ビル」へ通じる自動ドアがございますので建物内へお進みください



入って左手にエレベーターホールがございますので、【c】のエレベーターをご利用の上、15階（受付）へお進みください