

金融が直面する 新環境への対応と方法論



2018
12/20[木].21[金]

13:30-17:55 10:00-17:55

会場：ベルサール東京日本橋 ルーム 4、5
(東京日本橋タワー 5F)

〒103-6005 東京都中央区日本橋 2-7-1 東京日本橋タワー

事前登録不要・参加費無料

お問い合わせ先▶

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター シンポジウム
開催事務局 [山下智志、長幡英明 (nagahata[at]ism.ac.jp)]

詳細はホームページをご覧ください▶

http://www.ism.ac.jp/topevent_j/index.html

第6回金融シンポジウム

検索



国際金融規制改革

～バーゼルⅢの最終化と今後の課題～

白川俊介 金融庁総合政策局 審議官



新しい銀行像を求めて ～金融新環境への対応～

亀澤宏規 (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ
執行役専務グループCIO兼グループCDO



地域金融機関のビジネスモデル転換の方向性

高橋秀行 みずほ総合研究所 (株) 代表取締役社長



資産運用ビジネスとテクノロジー

～テクノロジーが変えること、変えないこと～

草鹿泰士 ロボット投信 (株) 代表取締役会長

安達哲也

PwC コンサルティング

池森俊文

統計数理研究所 特命教授

大屋幸輔

大阪大学 教授

荻原哲平

統計数理研究所 助教

川崎能典

統計数理研究所 教授

小池祐太

東京大学 准教授

後藤陽介

明治安田生命保険相互会社

西尾和記

住友生命保険相互会社

野村俊一

統計数理研究所 助教

三浦 翔

日本銀行

山下智志

統計数理研究所 副所長



統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター

第6回 金融シンポジウム

「金融が直面する新環境への対応と方法論」

事前登録不要・参加費無料

日時： 2018年12月20日（木） 13:30 - 17:55

2018年12月21日（金） 10:00 - 17:55

場所： ベルサール東京日本橋 **5F**（5FのフロアMAPは本プログラム末尾にあります）

- [住所] 東京都中央区日本橋2丁目7-1 東京日本橋タワー **5F**
- [交通アクセス]

- A** 日本橋駅 直結（銀座線・東西線・浅草線）
- B** 東京駅 八重洲北口より徒歩6分（JR線、丸ノ内線）
- C** 三越前駅 B6出口より徒歩3分（銀座線・半蔵門線）



お問い合わせ先：

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長
シンポジウム開催事務局長

山下智志
長幡英明（nagahata[at]ism.ac.jp）
（[at]を@に変換してご利用下さい）

本研究は JSPS 科研費 JP18H05290 および JP15H03390 の助成を受けたものです。

プログラム

12月20日(木)

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）

Session 1 金融データの統計解析手法の最前線

座長 荻原哲平（統計数理研究所 助教）

13:40 - 14:20	川崎能典（統計数理研究所 教授） 円滑閾値型推定方程式による与信スコアリング
14:20 - 15:00	大屋幸輔*（大阪大学 教授）、棕木伸吾（大阪大学） 平滑推移するリスクの市場価格をもちいた金利期間構造モデル
15:00 - 15:40	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） ビッグデータ時代における企業データの統計的名寄せ手法
15:40 - 15:55	Coffee Break

Session 2 金融を取り巻く環境変化とその対応策を巡って

座長 池森俊文（統計数理研究所 特命教授）

15:55 - 16:35	白川俊介（金融庁総合政策局 審議官） 国際金融規制改革－バーゼルⅢの最終化と今後の課題－
16:35 - 17:15	亀澤宏規（三菱 UFJ フィナンシャル・グループ 執行役専務グループ CIO 兼グループ CDTO） 新しい銀行像を求めて－金融新環境への対応－
17:15 - 17:55	高橋秀行（みずほ総合研究所 代表取締役社長） 地域金融機関のビジネスモデル転換の方向性

12月21日(金)

9:30 - 10:00

受付

Session 3 市場リスク評価の新技术

座長 川崎能典 (統計数理研究所 教授)

10:00 - 10:40

荻原哲平 (統計数理研究所 助教)

株価ボラティリティ・共変動の統計推測と機械学習

10:40 - 11:20

小池祐太 (東京大学 准教授)

高次元高頻度データを用いた最小分散ポートフォリオの推定

11:20 - 12:00

安達哲也 (PwC コンサルティング)

LIBOR 代替問題と金融商品価値評価：
マルチカーブからシングルカーブへ

12:00 - 13:30

Lunch Break

Session 4 金融テクノロジーの進化と業務革新

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

三浦翔 (日本銀行)

信用リスクへの勘定系データの利用、
その機械学習的アプローチ

14:10 - 14:50

草鹿泰士 (ロボット投信 代表取締役会長)

資産運用ビジネスとテクノロジー
ーテクノロジーが変えること、変えないことー

14:50 - 15:30

池森俊文 (統計数理研究所 特命教授)

銀行の自主的経営管理の数理的枠組みと課題

15:30 - 15:45

Coffee Break

Session 5 アクチュアリアル・データサイエンスの新展開

座長 渡邊重男 (MS&AD インシュアランスグループホールディングス)

15:45 - 16:25

後藤陽介 (明治安田生命保険)

将来キャッシュフロー計算におけるクラスタ分析を用いた
モデルポイント設定について

16:25 - 17:05

西尾和記 (住友生命保険)

国民トレンドを考慮した保険契約ポートフォリオの
将来死亡率推計

17:05 - 17:45

野村俊一 (統計数理研究所 助教)

多重線形モデルによる都道府県別生命表の解析

17:45 - 17:55

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)

ベルサール東京日本橋 5F のフロア MAP

