

The Nanzan 25th Anniversary Workshop on Finance

南山ファイナンス国際ワークショップ

(25周年記念大会)

わが国におけるファイナンスの理論的研究、実証的研究が着実に進展していく中で、ファイナンス研究に関心を持つ研究者および実務家が相集い、モノ作りの工房(ワークショップ)におけるように、研究課題を持ち寄り研 究を互いに深め、情報交換を行ない、かつファイナンス研究の社会的認知を得るための啓蒙活動と若い研究者に発表の場を提供することを目的として、南山ファイナンス・ワークショップを開催したのは、今から25年前の1979年(昭和54年)でした。その後、専門の学会であるファイナンス学会や日本金融・証券計量・工学会(JAFEE)が設立され、今日これらの学会のリーダーたちの多くがこのワークショップの常連であったという事実は、このワークショップが果たしてきた歴史的役割を物語っています。

そこで本年は25周年という記念すべき年にワークショップを開催するにあたり、下記の通り、海外からの参加者も募り国際ワークショップを企画致しました。もちろん、通常の学会の研究発表とは異なり最新の話題を丁寧に双方向でフリーに議論するという本ワークショップの伝統は維持されます。皆様の積極的なご参加をお待ちしています。

主催 : 南山ファイナンス・ワークショップ実行委員会
南山大学経営研究センター

共催 : 南山大学経営学研究科

日時および場所 : 2004年12月11日(土) <名鉄グランドホテル>
12日(日) <南山大学名古屋キャンパス・J棟101>
*アクセスについては添付の地図をご参照下さい。

ワークショップ参加費 : 無料

懇親会費 : 4000円

参加申し込み方法 : 下記事務局宛てに、11月30日までにメールまたは電話にてご連絡下さい。

実行委員長 : 徳永俊史(経営学部)

実行委員 : 赤壁弘康(経営学部) Marc Bremer(経営学部)
澤木勝茂(数理情報学部) 國田寛(数理情報学部)

事務局 : 〒466-8673 名古屋市昭和区山里18 南山大学
経営学部事務室(担当:橋田)
Tel : 052-832-4342
e-mail : tokunaga@nanzan-u.ac.jp (徳永俊史)

プログラム

< 12 / 11 (土): 名鉄グランドホテル >

9:30 - 10:00 受 付

10:00 - 11:10 開会の挨拶

10:10 - 11:10 (1) 中川秀敏 (東京工業大学)

Analyses of Mortgage-Backed Securities Based on Unobservable Prepayment Cost Processes

共著: 正田智昭 (株式会社エムティービーインベストメントテクノロジー研究所)

11:10 - 12:10 (2) 関根順 (大阪大学)

Explicit Solutions to Optimal Investment/Hedging Problems for Certain Nonlinear Stochastic Factor Models

共著: Hiroaki Hata (大阪大学)

12:10 - 13:30 昼 食

13:30 - 14:30 (3) Stanley Pliska (University of Illinois at Chicago)

Optimal Mortgage Refinancing with Endogenous Mortgage Rates: An Intensity Based, Equilibrium Approach

14:30 - 15:30 (4) Joe Chen (東京大学)

The Market Structure of Nasdaq Dealer Markets and Quoting Conventions

15:30 - 16:30 (5) Christine Parlour (Carnegie Mellon University)

Information Acquisition in a Dynamic Limit Order Market

16:30 - 18:00 記念パーティー (懇親会)

< 12 / 12 (日) 南山大学名古屋キャンパス・J棟 101 >

9:30 - 10:00 受付

10:00 - 10:50 (6) Yuri Kifer (Hebrew University)
Error Estimates for Binomial Approximations of Game Options

10:50 - 11:40 (7) Rama Cont (CNRS, Ecole Polytechnique)
Jump Diffusion Models and their Calibrations (仮題)

11:40 - 12:30 (8) 石田功 (東京大学)
How fast do financial market volatilities mean revert?
An empirical study using the S&P 500 daily returns data.

12:30 - 13:30 昼食

13:30 - 14:20 (9) 辻村元男 (京都大学)
Stock Repurchase Policy with Transaction Costs under Jump Risks
共著: 郷古浩道 (京都大学), 大西匡光 (大阪大学)

14:20 - 15:10 (10) 岩城秀樹 (京都大学)
Optimal Life Insurance for a Household
共著: 小守林克哉 (みずほ第一フィナンシャルテクノロジー)

15:10 - 15:20 休憩

15:20 - 16:10 (11) 芝田隆志 (横浜国立大学)
On the Value-Volatility Relationship in a Real Options Model

16:10 - 16:50 (12) 尾崎祐介 (大阪大学大学院)
The Comparative Statics on Equilibrium Derivative Prices
共著: 大西匡光 (大阪大学)

16:50 - 17:00 閉会の挨拶

< ご案内 >

- * 講演者の報告は、すべて英語で行なわれます。通訳サービスはありませんのでご了承下さい。
- * なるべく公共の交通機関にてお越し下さるようお願い致します。駐車場ご利用の場合は、名鉄グランドホテル・・・名鉄スカイパーキング 6F~11F をご利用下さい。南山大学名古屋キャンパス・・・大学内駐車場を利用下さい。
- * 参加者のご宿泊につきましては、各自でご手配下さるようお願い致します。

会場へのアクセス

< 名鉄グランドホテル >

〒450-0002

愛知県名古屋市中村区名駅 1-2-4 TEL : 052-582-2211 FAX : 052-582-2230

交通アクセス : JR名古屋駅より徒歩4分。名古屋空港より直行バス30分

駐車場 : 有り 400台 有料 1泊につき1,200円 駐車場ゲート 23:00~翌6:00 入出庫不可



18F	レストラン・ラウンジ
17F	
16F	客室
15F	
14F	
13F	写真室
12F	宴会場 日本料理
11F	宴会場 ロビー フロント
10F	
7F	
6F	メルサ EV ← 入口 名鉄スカイパーキング
5F	
4F	名鉄バスセンター (空港バス・高速バス発着)
3F	
2F	
1F	EV ← 入口
B1F	EV ← 入口 メルサ地下街

ホテル棟 (メルサ) B1 または 1 階よりホテル専用エレベーターにてお越しください。

< 南山大学名古屋キャンパス >

〒466-8673

名古屋市昭和区山里町 18 TEL/052-832-3111(代表)

地下鉄名城線「名古屋大学」駅1番出口より徒歩約10分 地下鉄名城線「八事日赤」駅より徒歩約5分

地下鉄鶴舞線「いりなか」駅1番出口より徒歩約15分

