

(社)日本オペレーションズ・リサーチ学会
平成12年度第4回 OR セミナー
『金融リスクとOR』

開催趣旨:

IT 社会の進展により、金融工学がますます脚光を浴びている。金融工学においては、OR 理論の応用される場面が数多い。OR 学会では、昨年まで「投資と金融の OR」研究部会が 10 年あまり活動を続けてきた。同研究部会を創設されるとともに、先駆的な研究・教育を推進してこられた、東京工業大学・今野教授(理財工学研究センター長)にオーガナイズをお願いして、今回下記のセミナーを開催するに至った。本セミナーでは、理論・実例面から、金融リスク評価に対する OR 理論の応用に関して、わかりやすく解説する。

日 時: 平成 12 年 12 月 5 日(火) 午前 10 時から午後 5 時

会 場: 中央大学理工学部 (東京都文京区春日 1-13-27) 6 号館 7 階 会議室 6701

プログラム:

10:00-11:45

「数理計画と市場・信用リスク」 東京工業大学 教授 今野 浩

はじめに金融工学における数理計画法の役割について紹介を行った後、資産運用における下方リスクモデル、市場リスク計量における条件付き VaR、半定値計画法による倒産判別に付いて説明する。

13:00-14:10

「市場リスクと信用リスクの統合」 ニッセイ基礎研究所金融研究部門 室町幸雄

ポートフォリオの市場リスクと信用リスクの統合評価は最近のホットな話題の一つであるが、この分野には首尾一貫した理論が確立されていなかった。本講演では、金利とデフォルト率を確率過程として表現することにより、自然な形で両者を統合評価できるフレームワークを提示し、その事例を紹介する。

14:20-15:30

「信用リスク管理とマルコフ連鎖」 東京都立大学 教授 木島正明

格付けは多くの金融機関で信用リスク管理の道具として使われているが、格付けの変動には相関があるので、相関を考慮したマルコフ連鎖によるモデル化が必要となる。本講演では、このようなモデル化および債券ポートフォリオ最適化への応用について考える。

15:50-17:00

「保険リスクの評価」 筑波大学 助教授 岩城秀樹

最近、価格理論において保険数理と金融工学の両者の融合を図ろうとする動きが見え始めている。本講演では、両者の融合に関する簡単なサーベイを行った後、金融工学的アプローチによる保険リスクの評価について解説する。

参加費： 正・賛助会員 25,000 円、学生会員 5,000 円、非会員 30,000 円

申込方法： 11月27日(月)までに学会事務局へ E-mail または FAX にて

E-mail: kenkyu@orsj.or.jp, FAX 03(3815)3352

なお、先着 60 名で締めきりますので、御了承下さい。

問合せ先： (社)日本オペレーションズ・リサーチ学会事務局 Tel. 03(3815)3351
〒113-0032 文京区弥生 2-4-16 学会センタービル内

会場案内：中央大学理工学部（東京都文京区春日 1-13-27）6号館 7階 会議室 6701
Tel. 03(3817)1680（情報工学科事務室）

J R 総武線水道橋駅下車、徒歩 10 分

営団地下鉄丸ノ内線・南北線後樂園駅下車、徒歩 5 分

都営地下鉄三田線春日駅下車、徒歩 7 分

アクセスマップは 下記をご覧ください。

<http://www.chuo-u.ac.jp/chuo-u/access/k-map.html>

(社)日本オペレーションズ・リサーチ学会 宛

FAX : 03-3815-3352 E-mail:kenkyu@orsj.or.jp

平成 12 年度第 4 回 OR セミナー「金融リスクと OR」参加申込書

平成 年 月 日

参加者氏名 (会員番号)	
勤務先 (又は学校名)	
勤務先住所 (又は 自宅住所)	〒
Tel/E-mail	
参加費	正・賛助会員： ¥25,000 名 / 学生会員： ¥5,000 名 非会員 : ¥30,000 名
支払方法	1. 銀行振込： 東京三菱銀行 千駄木支店 普通 0011000 住友銀行 白山支店 普通 697496 第一勧業銀行 根津支店 普通 1530801 2. 郵便振替： 東京 00190-6-79492 *上記 1, 2 の口座名は社団法人日本オペレーションズ・リサーチ学会 3. 現金書留 4. その他
支払日	年 月 日 請求書：不要 / 要 (宛先：)