

コンファレンス・プログラム

メインテーマ：グローバル金融危機後の新しい金利・為替評価手法の構築

(日本学術振興会科学研究費助成事業 研究種目基盤研究(B) 研究課題名「グローバル金融危機後の新しい金利・為替評価手法の構築」 (研究代表者：小川英治) 課題番号：25285098)

日時：6月5日(金) 13:30~17:30

場所：一橋大学 国立東キャンパス
マーキュリータワー5階 コンファレンスルーム2 (Room #3501)

13:30 開会の辞：一橋大学大学院商学研究科 小川英治

13:30 - 15:45 第1セッション 司会：一橋大学大学院商学研究科 花崎正晴

(1) 一橋大学大学院商学研究科 高見澤秀幸

“Impact of No-Arbitrage on Interest Rate Dynamics.”

討論者：東北大学大学院経済学研究科 室井芳史

(2) 一橋大学大学院商学研究科 中村恒

三隅隆司

高岡浩一郎

“Optimal Risk Sharing in the Presence of Moral Hazard under Market Risk and Jump Risk,” Japanese Journal of Monetary and Financial Economics, 2, 59-73, 2014.

討論者：一橋大学大学院国際企業戦略研究科 中川秀敏

(3) 一橋大学大学院商学研究科 小林健太

“A Mathematical Model of Price Fluctuations in the Financial Market.”

討論者：一橋大学大学院経済学研究科 山田俊皓

15:45 - 16:00 コーヒーブレイク

16:00 - 17:30 第2セッション 司会：一橋大学大学院商学研究科 三隅隆司

(1) 一橋大学大学院商学研究科 小川英治

王志乾

"Effects of Exit Strategy of the Quantitative Easy Monetary Policy on East Asian Currencies."

討論者：東京経済大学経済学部 熊本方雄

(2) 一橋大学大学院経済学研究科 塩路 悦朗

"Construction of stock-market based daily index of fiscal news for Japan."

討論者：一橋大学大学院経済学研究科 佐藤主光

17:30 閉会の辞：一橋大学大学院商学研究科 小川英治

17:30 懇親会

各論文 45 分（発表 25 分、討論 10 分、ディスカッション 10 分）