

京都大学大学院経済学研究科
金融・証券システム（大和証券グループ）寄附講座

金融工学研究会

平成17年3月23日（水）

会場：京都大学 法・経総合研究棟 3階第3教室

連絡先（E-mail）：daiwa@econ.kyoto-u.ac.jp

【午前の部】

10:00 - 11:00 **室町 幸雄**（ニッセイ基礎研究所・京都大学経済学研究科）
『デフォルト相関を考慮したポートフォリオの信用リスク計測モデル』

11:00 - 12:00 **辻村 元男**（京都大学経済学研究科）
“ Stock Repurchase Policy with Transaction Costs under Jump Risk ” with H. Goko and M. Ohnishi.

【午後の部】

13:30 - 14:30 **田中 敬一**（日本銀行）
“ A Simple Formulation of Swaption Prices by Gram-Charlier Expansion ”

14:30 - 15:30 **芝田 隆志**（横浜国立大学国際社会科学研究所）
“ Corporate value, Liquidation timing, and Agency Conflicts ”