

+++++

高頻度データ国内コンファレンス¹

Preparatory Meeting for the 5th Annual International Conference on
“High Frequency Exchange Rate and Stock Price Dynamics:
Econophysics and Econometric/Theoretical Analysis”

+++++

日時: 2021年9月7日(火), 9:30 - 16:30 (使用言語: 英語または日本語)
会場: オンライン開催
オーガナイザー: 伊藤隆敏 (コロンビア大学 / 政策研究大学院大学)
山田昌弘 (大阪大学)

参加希望者は必ず事務局 伊藤隆敏研究室 (t-ito2@grips.ac.jp) 宛に、「お名前、所属、Email Address、Zoom 表示名」をお知らせください。折り返し Zoom のリンクをお送りします。事前の登録がない場合は、入室を許可いたしません。

9:15 Zoom 接続開始 (9:25 より入室開始)

9:30 - 9:40 Welcome remarks

伊藤 隆敏 (コロンビア大学 兼 政策研究大学院大学)

9:40 - 10:40

高安 美佐子 (東京工業大学 科学技術創成研究院)

高安 秀樹 (東京工業大学 科学技術創成研究院)

渡利 広希 (東京工業大学 情報理工学院 修士2年)

「外国為替市場超高速取引トレーダーの注文頻度分析による非マルコフ的特性」

10:50 - 12:00

伊藤 隆敏 (コロンビア大学 兼 政策研究大学院大学)

山田 健太 (琉球大学 国際地域創造学部)

高安 美佐子 (東京工業大学 科学技術創成研究院)

高安 秀樹 (東京工業大学 科学技術創成研究院)

“No Free Lunch? Arbitrage Opportunities and Execution Risk in the Foreign Exchange Markets” (revised)

“New direction of HFT forex trading”

12:00 - 13:00

昼休み

13:00 - 14:00

大山 篤之 (金融庁・証券取引等監視委員会)

奥出 慎太郎、鈴木 賢太、福山義隆 (金融庁総合政策局)

「高速取引行為の特性分析」

14:10 - 15:10

山本 竜市 (早稲田大学政治経済学術院)

"High-frequency technical analysis and systemic risk indicators"

¹ This conference is organized with support from the Grant-in-aid (kaken), Japan Society for the Promotion of Science (JSPS), 17H00995.

15:20 – 16:20

服部 孝洋 (東京大学公共政策大学院)

「コロナ禍における IMF の SDR 配分に係る実証分」

16:20 – 16:30 Closing remarks

山田 昌弘・伊藤 隆敏

*発表時間は 45 分、質疑応答は 15 分。

+++++

List of participants (Speakers, Coauthors and Discussants)

In Alphabetical Order

論文発表者

伊藤 隆敏	コロンビア大学教授(兼)政策研究大学院大学客員教授
服部 孝洋	東京大学公共政策大学院特任講師
大山 篤之	証券取引等監視委員会事務局市場分析審査課取引審査官
高安 秀樹	ソニーコンピュータサイエンス研究所・東京工業大学科学技術創成研究院特任教授
高安 美佐子	東京工業大学科学技術創成研究院教授
山田 健太	琉球大学国際地域創造学部准教授
山田 昌弘	大阪大学数理・データ科学教育研究センター准教授
山本 竜市	早稲田大学政治経済学術院教授
渡利 広希	東京工業大学 情報理工学院 修士 2 年

参加者 (Invited)

有泉 秀	金融庁国際総括官
福山 義隆	金融庁総合政策局
原 尚子	日本銀行 金融研究所・経済ファイナンス研究課
色川 徹	チャイエックス・ジャパン株式会社代表取締役社長
祝迫 得夫	一橋大学経済研究所教授
金田 規靖	日本銀行 金融研究所・経済ファイナンス研究課
小谷中 奈美恵	東京フィナンシャルリサーチ(株)代表取締役社長
増原 剛輝	財務省国際局為替市場課資金管理室室長

増島 雄樹	ブルームバーグ エル・ピーエコノミクス部門主席エコノミスト(日本担当)
松本 千城	財務省国際局為替市場課長
松尾 琢己	日本取引所グループ総合企画部
水野 豪	日本取引所グループ総合企画部
水田 孝信	スパークス・アセット・マネジメント株式会社 ファンドマネージャー・上席研究員 東京大学公共政策大学院非常勤講師
大西 匡光	大阪大学大学院経済学研究科教授
太田 亘	大阪大学大学院経済学研究科教授
奥出慎太郎	金融庁総合政策局
大木 一寛	EBS ディーリングリソースジャパン(株)代表取締役
櫻井 駿平	東京証券取引所 IT 開発部
関根 敏隆	一橋大学国際・公共政策大学院教授
塩路 悦朗	一橋大学大学院経済学研究科 研究科長
鈴木 賢太	金融庁総合政策局リスク分析総括課マクロ分析室分析係
高橋 慎	法政大学経営学部准教授
高嵯 一郎	チャイエックス・ジャパン株式会社 コンプライアンス部長
若松 弘晃	東京証券取引所株式部
脇屋 勝	東京証券取引所情報サービス部
渡辺 努	東京大学大学院経済学研究科教授
張 思語	明治学院大学大学院 経済学研究科博士課程後期