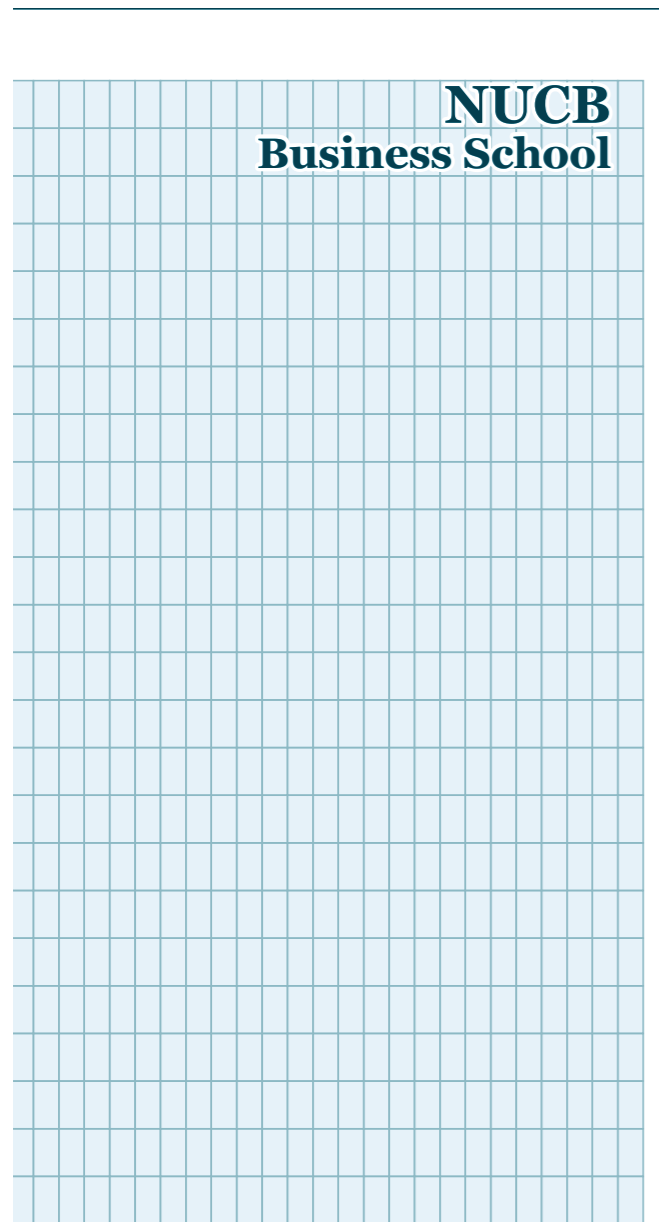


会場案内〈丸の内タワー〉
Information of venue 〈Nagoya Marunouchi Tower〉



12F INNOVATION LAB 50 #1 会場C
INNOVATION LAB 50 #2 会場D

9F AUDITORIUM 80 会場B

8F AUDITORIUM 80 会場A

6F AUDITORIUM 160 会場E

3F LEARNING SALON 昼食・懇親会(事前申込) ※10:00~16:30は、
休憩スペースとして
ご利用いただけます。

1F ENTRANCE 受付



2022年度 第4回秋季研究大会 委員会

大会委員長 岩澤 誠一郎

プログラム委員会

委員長 小林 武

委員 阿萬 弘行、伊藤 桂一、内田 交謹、内山 朋規、大槻 奈那、河瀬 宏則、坂和 秀晃、
佐藤 祐己、瀧野 一洋、太宰 北斗、南 ホチヨル、山分 俊幸、渡辺 直樹

NFA Fall Conference Program

2022年度

日本ファイナンス学会
第4回秋季研究大会

Nippon Finance Association
The 4th Fall Conference
Program

プログラム

期日：2022年11月5日(土)

Date Saturday, November 5, 2022

会場：名古屋商科大学大学院
名古屋キャンパス丸の内タワー

Venue Nagoya University of Commerce & Business, Nagoya Marunouchi Tower

〒460-0003 愛知県名古屋市中区錦1-3-1

1-3-1 Nishki, Naka-ku, Nagoya, Aichi 460-0003, Japan



	会場 A 8F Auditorium 80	会場 B 9F Auditorium 80	会場 C 12F Innovation Lab 50 #1	会場 D 12F Innovation Lab 50 #2
セッション1 10:00~11:20	〈イールドカーブ〉 座長：内山 朋規 (東京都立大学)	〈企業価値評価〉 座長：河瀬 宏則 (福岡大学)	〈株式市場とマーケットマイクロストラクチャー〉 座長：渡辺 直樹 (名古屋市立大学)	
第1報告 10:00~10:40	ドットチャートの形成と金融市場・経済のダイナミクス 報告者：齋藤 周 (年金積立金管理運用独立行政法人) 共著者：宮崎 浩一・木村 玄蔵・阿部 友樹 (年金積立金管理運用独立行政法人) 討論者：岩城 秀樹 (東京理科大学)	日本企業は現金保有を増加させているのか 報告者：山田 和郎 (京都大学) 討論者：佐々木 寿記 (東洋大学)	本邦株式市場における高頻度取引について 報告者：山田 昌弘 (東京理科大学) 討論者：高橋 慎 (法政大学)	
第2報告 10:40~11:20	Decomposing Asian Countries Yield Curve Comovement 報告者：小林 武 (名古屋商科大学) 討論者：大野 早苗 (武蔵大学)	技術競争力と企業価値評価：自社評価と他社評価の交互作用 報告者：竹原 均 (早稲田大学) 共著者：井出 真吾 (ニッセイ基礎研究所) 討論者：島田 佳憲 (埼玉大学)	Bank of Japan's ETF Purchase Program and The Share Lending Market 報告者：篠潤之介 (早稲田大学) 共著者：片桐 満 (法政大学)、高橋 耕史 (国際決済銀行) 討論者：三浦 真理子 (みずほ証券/一橋大学)	
11:20~11:30	休憩 Break			
セッション2 11:30~12:50	〈Asset pricing〉 座長：山分 俊幸 (名古屋商科大学)	〈Corporate governance〉 座長：坂和 秀晃 (名古屋市立大学)	〈非伝統的金融政策と株式市場〉 座長：大槻 奈那 (名古屋商科大学/ピクテ・ジャパン)	セッション2 11:30~12:30 〈Junior Session〉 <i>《English session》</i> Chair: Hiroyuki Aman [阿萬 弘行] (Kwansei Gakuin University)
第1報告 11:30~12:10	A Consumption-Based Term Structure Model of Bond and Equity 報告者：鈴木 雅貴 (一橋大学) 討論者：菊池 健太郎 (滋賀大学)	日本企業の取締役会におけるtokenism視点からのジェンダー多様性—コーポレートガバナンスコード導入黎明期の分析から 報告者：中嶋 幹 (武蔵大学) 共著者：白須 洋子 (青山学院大学)、小寺 英司 (インベスコ・アセット・マネジメント) 討論者：本多 俊毅 (一橋大学)	Stock and Distributional Effects of Bank of Japan Equity Purchases 報告者：一上 響 (慶應義塾大学) 討論者：山田 和郎 (京都大学)	第1報告 11:30~11:50 Had BoJ Intervention Attract ETFs' Private Investment? Speaker: Cadamuro Leonardo (Hitotsubashi University)
第2報告 12:10~12:50	ESG投資によるバリュー投資への影響—ESGが重要視される環境下のバリューファクターの解明— 報告者：内藤 誠 (東京都立大学/レオス・キャピタルワークス) 共著者：加藤 康之 (京都先端科学大学) 討論者：岩澤 誠一郎 (名古屋商科大学)	日本型コーポレート・ガバナンスの制度的補完性と進化 報告者：内田 交謹 (九州大学) 討論者：広田 真一 (早稲田大学)	QQE下における日本銀行のETF買い入れ 報告者：左三川 郁子 (日本経済研究センター) 討論者：沖本 竜義 (慶應義塾大学)	第2報告 11:50~12:10 Do COVID-19 Specific News Affect Stock Market Liquidity? Evidence from Japan Speaker: Wurong Yang (Nagoya City University) Co-author: Naoki Watanabe [渡辺 直樹] (Nagoya City University), Hideaki Sakawa [坂和 秀晃] (University)
12:50~13:50	昼食 Lunch			12:10~12:20 Mentor's Comment Mentor: Wataru Ohta [太田 亘] (Osaka University)
セッション3 13:50~15:10	〈金利デリバティブ〉 座長：瀧野 一洋 (名古屋商科大学)	〈Corporate Finance & Real Estate〉 座長：南 ホチヨル (北星学園大学)	〈年金資産運用〉 座長：伊藤 桂一 (SMBC日興証券)	12:20~12:30 Q & A
第1報告 13:50~14:30	Pricing Implications of Regulatory Reforms in an OTC Derivative Market: Evidences from IRS Transaction-Level Data 報告者：曾根 泰平 (日本銀行) 共著者：宮川 大介 (一橋大学)、小田 剛正 (日本銀行) 討論者：宇野 淳 (早稲田大学)	マザーズIPO企業の市場選択動機に関する分析：2013年以降の上場基準・上場廃止基準がIPO市場選択に与えた影響 報告者：中嶋 幹 (武蔵大学) 討論者：鈴木 健嗣 (一橋大学)	年金運用におけるホームバイアスのコスト—CAPMアプローチ— 報告者：内山 朋規 (東京都立大学) 共著者：上川 知雄 (格付投資情報センター) 討論者：臼杵 政治 (名古屋市立大学)	12:30~13:50 昼食 Lunch
第2報告 14:30~15:10	金利ボラティリティの期間構造を利用したスワップ投資戦略の考察 報告者：城川 寛明 (アセットマネジメントOne) 共著者：小畑 崇弘・山口 滉平 (アセットマネジメントOne)、酒本 隆太 (岡山大学) 討論者：小林 武 (名古屋商科大学)	不動産市場とリートの公募増資 報告者：伊藤 昌哉 (法政大学) 共著者：金 瑠 晋 (法政大学) 討論者：伊藤 隆康 (明治大学)	Investment Risk-taking and Benefit Adequacy under Automatic Balancing Mechanism in Public Pension System in Japan 報告者：北村 智紀 (武蔵大学) 共著者：木村 真 (兵庫県立大学)、中嶋 邦夫 (ニッセイ基礎研究所) 討論者：本多 俊毅 (一橋大学)	セッション3 13:50~15:10 〈企業の経営戦略とファイナンス〉 座長：佐藤 祐己 (慶應義塾大学)
				第1報告 13:50~14:30 A Dynamic Model of Repositioning with a Markov-Switching Regime 報告者：西出 勝正 (一橋大学) 共著者：海老名 剛 (明治大学) 討論者：辻村 元男 (同志社大学)
				第2報告 14:30~15:10 設備の非柔軟性と資本構成：日本企業についての実証分析 報告者：畠田 敬 (神戸大学) 共著者：太田 亘 (大阪大学) 討論者：山田 和郎 (京都大学)

	会場 E 6F Auditorium 160
	〈実務家・研究者連携セッション〉 ※特別公開セッション
15:20~16:20	〈ESG研究・実務の最前線〉 座長：内田 交謹 (九州大学) 講師：佐々木 隆文 氏 (中央大学 総合政策部 教授) 講師：平山 賢一 氏 (東京海上アセットマネジメント 参与 チーフストラテジスト、同社 サステナブル投資研究所 主席研究員)
	〈基調講演〉 ※特別公開セッション
16:30~17:30	「日本企業のコーポレートガバナンス」 座長：岩澤 誠一郎 (名古屋商科大学) 講師：新井 富雄 氏 (東京大学 名誉教授、東京都立大学 特任教授)
17:30~19:30	懇親会 3F Learning Salon ※事前申込が必要です