

ファイナンスの数理解析とその応用

Financial Modeling and Analysis

日 時 2020 年 9 月 17 日（木）・ 9 月 18 日（金）
場 所 オンライン（Zoom）
研究代表者 辻村 元男（同志社大学）

9 月 17 日（木）

- 12:55–13:00 開会挨拶

セッション 1（座長：久納 誠矢）

- 13:00–13:40
非対称 t 接合関数の性質・推定法とその応用
吉羽 要直（東京都立大学）
- 13:40–14:20
ビジネスサイクルが企業格付の変動に及ぼす影響について
廣中 純（野村アセットマネジメント株式会社）
- 14:20–15:00
ジャンプ過程と部分的観測にもとづく費用対効果が大きい環境管理について
吉岡 秀和*（島根大学）・辻村 元男（同志社大学）・濱上 邦彦（岩手大学）・吉岡 有美（島根大学）・八重樫 優太

セッション 2（座長：吉岡 秀和）

- 15:20–16:00
Optimal execution of pair trading with generalized price impacts
下清水 慎*（大阪大学）・大西 匡光（大阪大学）
- 16:00–16:40
Market Impact and its Decay
久納 誠矢（大阪産業大学）
- 16:40–17:20
連続時間モデルに基づく業績条件付きストック・オプションの価値評価
松本 敏幸（大阪大学）・大西 匡光*（大阪大学）・田中 寧々（EY 新日本有限責任監査法人）

9月18日（金）

セッション3（座長：ジョン ヘジュン）

- 13：00－13：40
A Note on Solutions of Real Options Model with a Quadratic Flow Function
後藤 允（北海道大学）
- 13：40－14：20
Investment under an earnings-based borrowing constraint
西原 理*（大阪大学）・芝田 隆志（東京都立大学）・Chuanqian Zhang（William Paterson University）
- 14：20－15：00
The Dynamics of Takeovers through Exchange Offers
鈴木 輝好（北海道大学）・八木 恭子*（東京都立大学）

セッション4（座長：後藤 允）

- 15：20－16：00
Time-to-build and capacity expansion
ジョン ヘジュン（東京理科大学）
- 16：00－16：40
Partially reversible capital investment with both fixed and proportional costs under demand risk
辻村 元男（同志社大学）
- 16：40－16：45 閉会挨拶