

ファイナンスの数理解析とその応用

Financial Modeling and Analysis

日 時 2023 年 8 月 30 日（水）－ 9 月 1 日（金）
場 所 京都大学数理解析研究所
研究代表者 辻村 元男（同志社大学）・後藤 允（東京理科大学）

8 月 30 日（水）

- 12：55－13：00 開会挨拶

セッション 1 座長：吉羽 要直（東京都立大学）

- 13：00－13：40
Simulation model for financial system-wide stress
浦谷 規（法政大学）
- 13：40－14：20
機械学習による政策不確実性の測定
土屋 惇*（東京理科大学）・伊藤 和哉（政策研究大学院大学）・高嶋 隆太（東京理科大学）

セッション 2 座長：辻村 元男（同志社大学）

- 14：35－15：15
信用イベント発生強度モデルによる信用サイクル変動要因の分析
廣中 純（筑波大学）
- 15：15－15：55
楯円接合関数の裾従属性と金融リスク管理
吉羽 要直（東京都立大学）
- 16：00－16：40
Risk Bearing Capacity and Market Liquidity under Asymmetric Information
北島 貴一*（一橋大学/三菱 UFJ トラスト投資工学研究所）・西出 勝正（一橋大学）

8月31日（木）

セッション3 座長：西原 理（大阪大学）

- 10：00－10：40
パンデミックオプションについて
北村 悠人*（東京理科大学）・下清水 慎（東京理科大学）・後藤 允（東京理科大学）
- 10：40－11：20
Optimal Lockdown Decisions of the Stochastic SIR Model Controlling Medical Resources
八木 恭子（東京都立大学）・佐藤公俊（神奈川大学）・澤木勝茂*

セッション4 座長：石島 博（中央大学）

- 13：00－13：40
The effects of an earnings-based covenant on capital structure and firm value
西原 理*（大阪大学）・芝田 隆志（東京都立大学）
- 13：40－14：20
Illiquidity default or insolvency default
田 園（龍谷大学）

セッション5 座長：田 園（龍谷大学）

- 14：35－15：15
CSR投資とリスクプレミアム ーリアルオプションアプローチ
大賀 雄太郎*（東京理科大学）・伊藤 和哉（政策研究大学院大学）・高嶋 隆太（東京理科大学）
- 15：15－15：55
A U-Shaped Curve Hypothesis on the Relationship between Corporate ESG activity and Financial Performance
前田 章*（東京大学）・石島 博（中央大学）
- 16：00－16：40
A Note on ESG CAPM and Carbon Reduction Index Funds
石島 博*（中央大学）・Masato Yamamoto（Yale University）・前田 章（東京大学）

9月1日（金）

セッション6 座長：後藤 允（東京理科大学）

- 10：00－10：40
Performance of benchmark execution algorithms and optimal execution strategies under various market conditions
久納 誠矢（同志社大学）
- 10：40－11：20
オーリッチリスクの資源・環境問題への応用
吉岡 秀和*（北陸先端科学技術大学院大学）・辻村 元男（同志社大学）

セッション7 座長：芝田 隆志（東京都立大学）

- 13：00－13：40
マルチファクターモデルによる日本の電力スポット市場価格変動に関する検討
落合 夏海（兵庫県立大学）
- 13：40－14：20
The Impact of Commodity Currencies: Exporting Resource Countries vs. Importing Resource Countries
大川 寛之（神戸大学）

セッション8 座長：久納 誠矢（同志社大学）

- 14：35－15：15
Investment timing, upper reflecting barrier, and debt-equity financing
芝田 隆志*（東京都立大学）・西原 理（大阪大学）
- 15：15－15：55
不確実性下における価格規制と資本投資
辻村 元男*（同志社大学）・後藤 允（東京理科大学）・高嶋 隆太（東京理科大学）・吉岡 秀和（北陸先端科学技術大学院大学）
- 15：55－16：00 閉会挨拶