

---

---

# ファイナンスの数理解析とその応用

## Financial Modeling and Analysis

日 時            2019年9月19日(木)～9月20日(金)  
場 所            同志社大学 扶桑館 307  
研究代表者      辻村 元男 (同志社大学)

---

---

### 9月19日(木)

- 13:00-13:05 開会挨拶

#### セッション1 (座長: 井上 昭彦)

- 13:05-13:45  
容量メカニズムの経済分析  
寺尾 蒼大\* (東京理科大学・大学院理工学研究科)・伊藤 真理 (東京理科大学・理工学部)・高嶋 隆太 (東京理科大学・理工学部)・牧本 直樹 (筑波大学・ビジネス科学研究科)
- 13:45-14:25  
炭素税の課税負担の比較  
児玉 友樹\* (東京理科大学・大学院理工学研究科)・高嶋 隆太 (東京理科大学・理工学部)・伊藤 真理 (東京理科大学・理工学部)

#### セッション2 (座長: 吉岡 秀和)

- 14:40-15:20  
Pollution abatement strategy with ambiguous technological change  
辻村 元男\* (同志社大学・商学部)・吉岡 秀和 (島根大学・学術研究院環境システム科学系)
- 15:20-16:00  
伊藤 ARMA 過程に対する数値解析とファイナンスへの応用  
井上 昭彦 (広島大学・大学院理学研究科)
- 16:00-16:40  
新規上場市場におけるアンダープライシングと流通市場の流動性  
松本 宗谷 (同志社大学・商学研究科)

#### 懇親会 (18:00-20:00)

## 9月20日（金）

### セッション3（座長：山崎 和俊）

- 10：00－10：40  
本邦企業が発行する円建て社債スプレッドの変動要因について  
宇治田 達哉（野村アセットマネジメント株式会社）
- 10：40－11：20  
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）

### 昼休み（11：20－13：00）

### 基調講演（座長：辻村 元男）

- 13：00－14：15  
積分変換によるオプション価格評価：現状と展望  
木村 俊一（北海道大学・名誉教授）

### セッション4（座長：廣中 純）

- 14：30－15：10  
On discrete and costly observations in environmental and biological management  
吉岡 秀和\*（島根大学・水圏エコシステムプロジェクトセンター）・辻村 元男（同志社大学・商学部）
- 15：10－15：50  
The Leland-Toft optimal capital structure model under Poisson observations  
Zbigniew Palmowski (Wroclaw University of Science and Technology)・Jose Luis Perez (CIMAT)・Budhi Arta Surya (Victoria University of Wellington)・山崎和俊\*（関西大学・システム理工学部）  
(Kansai University)
- 15：50－16：30  
保険リンク債と再保険のモデル  
浦谷 規（法政大学・理工学部）
- 16：30－16：35 閉会挨拶