

ファイナンスの数理解析とその応用
Financial Modeling and Analysis
RIMS 共同研究（公開型）報告集

2023 年 8 月 30 日～9 月 1 日
研究代表者 辻村 元男 (Motoh Tsujimura)
研究代表者 後藤 允 (Makoto Goto)

目次

1. コロナ対策のゼロゼロ融資とストレス・モデル
浦谷 規 (Tadashi Uratani) 法政大学 (Hosei U.)
2. 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 (Jun Hironaka) 筑波大学 (U. Tsukuba) /
三井物産デジタル・アセットマネジメント株式会社
(Mitsui & Co. Digital Asset Management, Ltd.)
3. 楕円接関数の裾従属性と金融リスク管理
吉羽 要直 (Toshinao Yoshiba) 東京都立大学 (Tokyo Metropolitan U.)
4. Optimal Lockdown Decisions of the Stochastic SIR Model with the Allocation
Medical Resources
八木 恭子 (Kyoko Yagi) 東京都立大学 (Tokyo Metropolitan U.)
佐藤 公俊 (Kimitoshi Sato) 神奈川大学 (Kanagawa U.)
澤木 勝茂 (Katsushige Sawaki) 青山学院大学 (Aoyama Gakuin U.)
5. 企業 ESG 活動と財務業績に関する U 字型関係仮説
前田 章 (Akira Maeda) 東京大学 (U. Tokyo)
石島 博 (Hiroshi Ishijima) 中央大学 (Chuo U.)
6. A Note on ESG CAPM and Carbon Reduction Index Funds
石島 博 (Hiroshi Ishijima) 中央大学 (Chuo U.)
Masato Max Yamamoto Yale School of Management
前田 章 (Akira Maeda) 東京大学 (U. Tokyo)
7. Performance of benchmark execution algorithms
久納 誠矢 (Seiya Kuno) 同志社大学 (Doshisha U.)

8. オーリッチリスクの資源・環境問題への応用.....
吉岡 秀和 (Hidekazu Yoshioka) 北陸先端科学技術大学院大学
(Japan Advanced Institute of Science and Technology)
辻村 元男 (Motoh Tsujimura) 同志社大学 (Doshisha U.)
9. The Fluctuation Factors of Commodity Currencies:
Exporting Resource Countries vs. Importing Resource Countries
大川 寛之 (Hiroyuki Okawa) 神戸大学 (Kobe U.)
10. 価格規制を考慮したアウトプット価格のリスク下における資本投資.....
辻村 元男 (Motoh Tsujimura) 同志社大学 (Doshisha U.)
吉岡 秀和 (Hidekazu Yoshioka) 北陸先端科学技術大学院大学
(Japan Advanced Institute of Science and Technology)
高嶋 隆太 (Ryuta Takashima) 東京理科大学 (Tokyo U. of Science)
後藤 允 (Makoto Goto) 東京理科大学 (Tokyo U. of Science)