

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

2025/8/27 ~ 2025/8/29

研究代表者 後藤 允 (Makoto Goto)
研究代表者 辻村 元男 (Motoh Tsujimura)

目次

1. 信用イベント発生強度モデルによるクレジットサイクルの変動要因の分析
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.)
2. Optimal Contracts for Off-Exchange Trading with Generalized Price Impact Model
比留木 幹人 (Mikito Hiruki) 東京大学 (U. Tokyo)
久納 誠矢 (Seiya Kuno) 同志社大学 (Doshisha U.)
3. Generalization and Adaptation in Option Hedging Strategies Using Deep Learning
久納 誠矢 (Seiya Kuno) 同志社大学 (Doshisha U.)
4. Continuous-time optimal pair-trade execution with cross-impacts and
common risk factors
大西 匡光 (Masamitsu OHNISHI) 大和大学 (Yamato U.) /
大阪大学 (Osaka U.)
下清水 慎 (Makoto SHIMOSHIMIZU) 東京理科大学
(Tokyo University of Science)
5. 投資費用の不確実性と撤退オプションを考慮した風力発電事業の価値評価
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 (JAIST)
6. ESG と企業業績の U 字曲線理論モデル
前田 章 (Akira Maeda) 東京大学 (U. Tokyo)
石島 博 (Hiroshi Ishijima) 中央大学 (Chuo U.)