

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

2021 年 9 月 8 日～9 月 10 日
研究代表者 辻村 元男 (Motoh Tsujimura)

目次

1. Optimal execution under a generalized price impact model with Markovian exogenous orders in a continuous-time setting
深澤 正彰 (Masaaki Fukasawa) 大阪大学 (Osaka U.)
大西 匡光 (Masamitsu Ohnishi) 大阪大学 (Osaka U.)
下清水 慎 (Makoto Shimoshimizu) 東京都立大学 (Tokyo Metropolitan U.)
2. Limit Order Book Dynamics with Large Executions
久納 誠矢 (Seiya Kuno) 大阪産業大学 (Osaka Sangyo U.)
3. Cat Bond for Extreme events
浦谷 規 (Tadashi Uratani) (株)ミックナイン (MIC.9 Co. Ltd)
4. Covid-19 による WTI 先物市場のボラティリティの変動に関する研究.....
大川 寛之 (Hiroyuki Okawa) 和歌山大学 (Wakayama U.)
5. ESG を考慮した資産価格評価モデルに関するノート
石島 博 (Hiroshi Ishijima) 中央大学 (Chuo U.)
前田 章 (Akira Maeda) 東京大学 (U. Tokyo)
6. 環境管理方針の策定におけるアーラン化と曖昧性
吉岡 秀和 (Hidekazu Yoshioka) 島根大学 (Shimane U.)
辻村 元男 (Motoh Tsujimura) 同志社大学 (Doshisha U.)
7. Real Options in Stochastic SIR Model
後藤 允 (Makoto Goto) 北海道大学 (Hokkaido U.)
田 園 (Yuan Tian) 龍谷大学 (Ryukoku U.)
8. 確率的なアウトプット需要と資本価格の下における, 2 種類の変更費用を考慮した
資本ストックの規模変更について.....
辻村 元男 (Motoh Tsujimura) 同志社大学 (Doshisha U.)