

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

2024 年 9 月 4 日～ 9 月 6 日

研究代表者 後藤 允 (Makoto Goto)

研究代表者 辻村 元男 (Motoh Tsujimura)

目次

1. Financial risk transfer of Catastrophe
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. A Note on ESG Factor Models
石島 博 (Hiroshi Ishijima) 中央大学 (Chuo U.)
前田 章 (Akira Maeda) 東京大学 (U. Tokyo)
4. Economic Relationship Between Critical Minerals and Fossil Energies
大川 寛之 (Hiroyuki Okawa) 神戸大学 (Kobe U.)
5. 動的な非対称 t 接合関数を用いた多変量資産価格変動の把握.....
夷藤 翔 (Kakeru Ito) 東京都立大学 (Tokyo Metropolitan U.)
吉羽 要直 (Toshinao Yoshiba) 東京都立大学 (Tokyo Metropolitan U.)
6. Optimal Execution Price for Off-exchange Trading
久納 誠矢 (Seiya Kuno) 同志社大学 (Doshisha U.)
7. 連続行為空間上の進化ゲームならびに関連した平均場ゲーム.....
吉岡 秀和 (Hidekazu Yoshioka) 北陸先端科学技術大学院大学 (JAIST)
辻村 元男 (Motoh Tsujimura) 同志社大学 (Doshisha U.)

8. Continuous-time optimal execution under a transient market impact model
in a Markovian environment
 深澤 正彰 (Masaaki Fukasawa) 大阪大学 (Osaka U.)
 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 U. of Science)

9. リスク下における長期脱炭素電源オークションを考慮した風力発電の価値評価
 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)