
ファイナンスの数理解析とその応用

Financial Modeling and Analysis

日 時 2024 年 9 月 4 日（水）－ 9 月 6 日（金）
場 所 京都大学数理解析研究所
研究代表者 後藤 允（東京理科大学）・辻村 元男（同志社大学）

9 月 4 日（水）

- 12：25－12：30 開会挨拶

セッション 1 座長：辻村 元男（同志社大学）

- 12：30－13：10
Financial risk transfer of Catastrophe
浦谷 規（法政大学）
- 13：10－13：50
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（三井物産デジタル・アセットマネジメント／筑波大学）

セッション 2 座長：八木 恭子（東京都立大学）

- 14：05－14：45
A Note on ESG Factor Models
石島 博*（中央大学）・前田 章（東京大学）
- 14：45－15：25
Economic relationships between critical minerals and fossil energies
大川 寛之（神戸大学）

セッション 3 座長：石島 博（中央大学）

- 15：40－16：20
Entry-Exit strategies for venture capitalist: A cash flow based model
佐久間 斗美雄*（東京理科大学）・鈴木 幹（東京理科大学）・下清水 慎（東京理科大学）・
後藤 允（東京理科大学）
- 16：20－17：00
Earnouts in mergers and acquisitions under asymmetric information
鈴木 輝好（北海道大学）・八木 恭子*（東京都立大学）

9月5日(木)

セッション4 座長：久納 誠矢 (同志社大学)

- 09:30-10:10
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 (ニッセイアセットマネジメント/東京都立大学)・吉羽 要直* (東京都立大学)
- 10:10-10:50
The agency problem in sustainability between the owner and the manager
王 鐘立* (大阪大学)・西原 理 (大阪大学)
- 10:50-11:30
Optimal Execution Price for Off-exchange Trading
久納 誠矢 (同志社大学)

セッション5 座長：吉岡 秀和 (北陸先端科学技術大学院大学)

- 13:00-13:40
How do pro-ESG investors affect a firm's investment timing, financing, and sustainability decisions?
西原 理 (大阪大学)
- 13:40-14:20
Analyzing pandemic options under a stochastic SIR model
北村 悠人* (東京理科大学)・高柳 信吾 (東京理科大学)・下清水 慎 (東京理科大学)・後藤 允 (東京理科大学)

セッション6 座長：西原 理 (大阪大学)

- 14:35-15:15
Non-local Variational Inequality on optimal working capital problem
豊泉 洋* (早稲田大学)・小池 茂昭 (早稲田大学)
- 15:15-15:55
Post-Last Exit Time Process and its Application to Loss-Given-Default Distribution
江上 雅彦 (京都大学)・Kevkhisvili Rusudan* (京都大学)
- 15:55-16:35
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* (北陸先端科学技術大学院大学)・辻村 元男 (同志社大学)
- 17:30-19:30 懇親会
芙蓉園 (<https://kyoto-fuyouen.jp/>)
会費：4,000円

9月6日(金)

セッション7 座長：芝田 隆志(東京都立大学)

- 10:00-10:40
Continuous-time optimal execution under a transient price impact model in a Markovian environment
深澤 正彰(大阪大学)・大西 匡光(大和大学)・下清水 慎*(東京理科大学)
- 10:40-11:20
電力購入契約のリアルオプション
大賀 雄太郎*(東京理科大学)・伊藤 和哉(東京理科大学)・高嶋 隆太(東京理科大学)

セッション8 座長：後藤 允(東京理科大学)

- 13:00-13:40
The effects of time-to-build and regulation on investment timing and size
ジョン ヘジューン(東京理科大学)
- 13:40-14:20
Investment, partial irreversibility, and competition
西原 理(大阪大学)・芝田 隆志*(東京都立大学)・田 園(龍谷大学)
- 14:20-15:00
Assessing a wind power generation capacity with considering spot and capacity markets under price risk
辻村 元男*(同志社大学)・吉岡 秀和(北陸先端科学技術大学院大学)
- 15:05-15:10 閉会挨拶