

## ○ワークショップ「ファイナンス」

開催責任者 経営学部 竹澤直哉

ビジネス研究科 池田亮一

2016年10月29日

10月30日

南山大学名古屋キャンパス J棟 1階特別合同研究室



ワークショップは以下のとおり、開催された。

### ◇報告者および題目

10月29日（土）

1. 落合夏海（大阪大学）  
“Valuation of Game Swaptions under the Generalized Ho-Lee Model”
2. 陳栩龍（横浜国立大学）  
“Rare disasters and the term structure of real interest rates”
3. 鈴木雅貴（横浜国立大学）  
“Equity Premium, Term Spread, and Credit Spread: Equilibrium Asset Pricing with Ambiguity”

10月30日（日）

1. 齋藤伽織（南山大学）

「流動化プロセスにおけるセンチメントの影響」

2. 竹澤直哉（南山大学）

“The influence of Oversea Investors on Japanese Socially Conscious Funds”

#### ◇ワークショップの討論内容

目標に沿い、大学院生2名および2016年3月に卒業した研究生1名を含む研究発表が行われた。また、リスク管理に行動ファイナンスの手法を取り入れた研究発表も行われた。発表時間を超えて活発な討論が行われ、研究報告に関するコメントや意見も交換された。

#### ◇研究成果発表

池田亮一、「消費ベースモデルによる利子率の期間構造の分析」、経営財務研究、第31巻第1号、2011年。