

2021 年度 傾斜的研究費（全学分）若手研究者独立基盤形成支援枠 研究報告書

【研究費区分】：若手研究者独立基盤形成支援枠

【所属】：経済経営学部

【氏名】：吉羽 要直

【氏名フリガナ】：ヨシバ トシナオ

【職】：教授

【研究課題名】：金融リスク管理に用いる多変量接合関数の分析

【研究実績の概要】

- ・金融リスク管理では、ストレス状況把握の観点から、多数の資産価格変動で下落方向への従属性が高まる現象を把握することが重要である。本研究では、こうした状況を捉えられる変量間の依存関係を表す多変量接合関数の分析を行っている。
- ・2021 年度は 2 変量接合関数の極値での従属性や非対称正規接合関数の非対称性尺度について調査を進め学会発表したほか、関連する 2 本の査読付論文を公表した
- ・また、接合関数を用いた誤方向リスクの分析でローン担保証券の市場価格からモデルを較正するため、取引価格データの整備を図った。

【本支援を用いた研究基盤整備の達成状況について】

- ・本支援をすべて用いて上述のローン担保証券の市場取引価格データの整備を行った（2021 年 11 月）。

【本支援を用いた具体的な研究グループの形成について】

- ・ローン担保証券の市場取引価格データからモデルを較正する研究について、指導に携わった学生などとともに分析を進めている。