

主な著作物

刈屋武昭 ファカルティフェロー

- 著書 『不動産金融工学とは何か』 (2003) 東洋経済新報社
『金融工学とは何か - リスクから考える』 (2000) 岩波新書
『信用リスク分析の基礎 - 保険リスクのプライシング』 (1999)
東洋経済新報社
『金融工学の基礎』 (1997) 東洋経済新報社
『債券計量分析の基礎と応用』 (1995) 東洋経済新報社
『計量経済分析法の新展開』 (1994) 岩波書店
『ポートフォリオ計量分析の基礎』 (1990) 東洋経済新報社
『計量経済分析の考え方と実際』 (1986) 東洋経済新報社
『回帰分析の理論』 (1979) 岩波書店
- 共著書 『経済時系列分析』 (2003) (田中勝人氏・矢島美寛氏) 岩波書店
『金融工学入門』 (2002) (小暮厚之氏) 東洋経済新報社
『非線形経済時系列法とその応用』 (1997) (照井伸彦氏) 岩波書店
『統計学』 (1994) 東洋経済新報社 (勝浦正樹氏と)
『三日間の計量経済学入門』 (1991) JIC出版社 (佐和隆光氏らと)
『日本の株価変動』 (1989) 東洋経済新報社 (佃良彦氏らと)
『合理的予想インフレ・為替変動分析』 (1988) (深尾京司氏らと) 有斐閣
『経済時系列分析入門』 (1983) (溝口敏行氏と共著) 日本経済新聞社
- 監修 『計量経済分析の基礎と応用』 (1984) (日本銀行調査統計局) 東洋経済新報社
- 編著書 『金融・証券計量分析の基礎と応用』 (1990) 東洋経済新報社
- 共編著書 『ジャレフジャーナル2003 不動産金融工学と不動産市場の活性化』 (2003)
(藤田昌久氏) 東洋経済新報社
『リスク管理と金融・証券投資戦略』 (1998) (森棟公夫氏) 東洋経済新報社
『金融・証券投資戦略の新展開』 (1995) (森棟公夫氏) 東洋経済新報社
『基本テキスト: 金融証券数量分析入門』 (1991) (佃氏) 東洋経済新報社
『現代経済学の新展開』 (1985) (時子山氏らと) 有斐閣

『統計学』(1978)(溝口氏) 青林書院

監修訳書 『年金学入門』(2000) きんざい

共訳書 『収益を作る戦略的リスクマネジメントー米国優良企業の成功事例』
(Tomas L.Barton, William G.Shenkir, Paul L.Walker 著)
刈屋武昭, 佐藤勉, 藤田正幸 訳(東洋経済新報社; 2003)
『ノンパラメトリックス』(レーマン)(1980)(鍋谷氏らと) 森北出版

論文(和文)

- [51] 「ARCH型分散変動モデルによる気温リスク・スワップの検証」(2004)
刈屋武昭, Tee Kian Heng, 郷古浩道
- [50] 気温TTリスクスワップの等価性の検証(2003)(牛山・遠藤)
- [49] 不動産収益還元D D C F 価値分布の特性(2002.3)(大原・本河)
『ジャレフジャーナル2003 不動産金融工学と不動産市場の活性化』(163-181)
- [48] 不動産収益還元価値評価モデル(2000.11) 『ジャレフジャーナル2003 不動産金融工学と不動産市場の活性化』(143-162)
- [47] 信用リスクと保険リスクを合わせた統合ポートフォリオの有効性:バンシュランスの理論的妥当性 『ジャフィージャーナル2001 金融工学の新展開』(2001.4 73-88)
- [46] 不動産収益還元価値評価モデルと賃料キャッシュフローのリスク分析法
商業用不動産リアルオプション価値評価法 (2001.3)
(加藤康之氏・内山朋規氏・諏訪部貴嗣氏)
- [45] 無裁定価格理論:離散時間アプローチと連続時間アプローチの比較
『応用数理』(2001.12 Vol.11 No4 29-37)
- [44] 確定給付年金の制度リスク管理 『計測と制御』(2000.7 Vol.39 435-440)(関根賢二氏と)
- [43] 金融工学は燃えている 『エコノミスト』(2000.4)
- [42] 21世紀の金融と金融工学 『証券アナリストジャーナル』(2000.1)
- [41] 米国モーゲージ証券の価格評価法 『資産流動化研究』(1999)資産流動化研究所
(小林正明氏と共著)
- [40] 国際分散投資によるリスクヘッジ法 『リスク管理と金融証券投資戦略』(1998)
ジャフィージャーナル
- [39] 時間依存型マルコフモデルによる転換社債モデル 『リスク管理と金融証券投資戦略』
(1998) ジャフィージャーナル(津田博史氏と共著)
- [38] 一般化最小2乗法の理論の展望
『福島大学経済学論集』(1998)(倉田博史氏と共著)
- [37] 計量経済モデル分析法のサイアティフィックアート 『E P A』(1998.9)
- [36] 離散時間マルチンゲール・無裁定オプション理論(1996) 『経済研究』 47巻
- [35] ルーカス教授の業績と期待形成学派(1996) 『数学セミナー』 2月号
- [34] 株式持ち合い日本型「資本主義」の自律失調症(1996) 『ビジネス・レビュー』
- [33] B I S 市場リスク管理規制が日本の金融システムを変える(1995)
『金融ビジネス』 1月号

- [32] 新しい債券価格モデルと投資技法 (1995) 『調査月報』ニッセイ基礎研究所 (津田博史氏と共著)
- [31] 時間依存型マルコフモデルによる債券価格の予測 (津田博史氏と共著) (1995) 『ジャフィー・ジャーナル 1995』
- [30] オプション理論の考え方と応用可能性 (1995) 『成城大学経済研究所年報』8号
- [29] 多変量正規性の検定 (1994) 『経済研究』45巻
- [28] 株価・為替レート時系列変動の長期依存性の検証 (1992) 『一橋論叢』108巻 6号 939-946. (勝浦正樹氏と共著)
- [27] 統計的債券価格変動モデル (1992) 『経済研究』43巻、4号
- [26] 金融資産価格変動分析におけるクウォンツとMPT (1991) 『調査月報』10月 ニッセイ基礎研究所
- [25] 可変パラメータ・非線形MTVモデル (1991)
- [24] サーベイ調査における欠測値モデルの基礎 (1991) 『統計調査』総務庁
- [23] 地域経済動向MTV連関分析 (1990) 『経済研究』
- [22] 地域経済動向MTV分析 (1989) 『地域経済動向の新たな計量的分析手法に関する調査研究』産業研究所
- [21] 基準化正規CP指数と日銀『短観』判断データによる景気分析 (1989) 『経済研究』40巻 1号
- [20] Stock=Watsonのモデル論的景気分析法 『景気とサイクル』
- [19] 非線形分散変動モデルによる日次週次為替レート分析 (1988) (松江由美子氏と共著) 『金融研究』
- [18] 最近の株式市場とリスクと政策 (1987) 『ESP 6月号』
- [17] MTVモデルと株価予測 (1987) 『社会科学の計量分析』東京大学出版会
- [16] 経済現象における因果の考え方と検証可能性 (翁邦雄氏と共著) 『経済研究』38巻 153-165
- [15] 計量経済モデルへの合理的予測形成仮説の導入とインフレ・為替分析への応用 (1986) 『経済分析 105号』経済企画庁
- [14] 合理的メディアン予測と非線形モデルへの応用 (1986) 『現代経済学の新展開』有斐閣
- [13] 『景気動向指数』採用系列における「景気」とMTVモデルによる景気予測 (1986) 『景気観測資料の体系的整備に関する調査』統計研究会
- [12] 多変量時系列変動要因分析モデル 『経済研究』(1986) 37巻
- [11] 検定のロバストネス (1985) 『一橋論叢』94巻 21-44
- [10] 最近の経済時系列分析の2書に寄せて (1985) 『経済研究』36巻 176-179
- [9] 『景気動向指数』採用系列の統計解析とコンポジットインデックス (1985) 『景気観測方法の充実に関する調査』統計研究会
- [8] 改定『景気動向指数』採用系列における「景気」と加速度DI (1984) 『景気変動の分析と予測に関する調査』統計研究会
- [7] 成長曲線モデルにおける仮説検定 (1984) 『経済研究』35巻
- [6] 新しい経済指標作成の方法 (1983) 『経済研究』34巻 40-49

- [5] 「回帰分析の理論」補論 (1979) 『経済研究』 30巻 358-378
- [4] サービスの価格と生産性の測定 (1978)(企画庁物価班)統計研究会
- [3] 回帰分析における検定仮説の識別性とOLSとGLSEの選択 (1977)
『経済研究』 28巻 272-281
- [2] 回帰分析におけるバイアス推定量の選択 『経済研究』 (1976) 27巻 250-270
- [1] 2SLSに基づく識別性の検定 『一橋論叢』 (1971) 65巻 3号 424-431

その他

- [24] 学際的研究への期待 『情報処理』 (1996)
- [23] 経済指数とリスクと先物指数(1996)
- [22] 途中継続・非継続の選択権をもつオプションの評価
- [21] 優先株式の価格理論(1997)
- [20] 豊岡君とのGLSE共同研究(1998)
- [19] 金融システムの再構築は資本市場を受け皿に 『日経金融新聞』 (1998.9.3)
- [18] 金融工学私的元年 『ジャフィー会報』 (1999.8)
- [17] ファイナンシャルテクノロジー 『金融時事用語集』 (1999.3)
- [16] 学究生活から金融テクノロジー応用の場へ 『リアルタイム』 (1998.11)
- [15] 投資工学の重要性 『リアルタイム』 (1996.10)
- [14] 金融工学の時代 『郵政調査月報』 (1995,10)
- [13] ロバスト判別分析法についてのノート
- [12] 平均市場スポット・レート関数の推定 Discussion Paper No.124
- [11] 可変パラメータ・非線形MTVモデルと金利の期間構造
MTV - GARCH分析 (1992) Discussion Paper No.123
- [10] 大阪市立大学 『経済学辞典』 (1991) (時系列分析)
- [9] 「景気指標の方法について」 『地域経済動向の新たな計量的分析手法に関する調査研究』
産業研究所
- [8] 竹内編 『統計学辞典』 (10項目) (1989)東洋経済新報社
- [7] 高橋・増田編 『体系経済学辞典』 (10項目) (1985)東洋経済新報社
- [6] 書評：大野克人・マートン編著 『金融技術革命』 (『金融ビジネス』)(1996)
- [5] 書評：森棟公夫著 『経済モデルの推定と検定』 (『経済研究』)
- [4] 書評：Tiao ed. The Collected Works of George E.P. Box
- [3] 書評：竹内編 『計量経済学の新展開』 (『経済学論集』)
- [2] 計量モデルと最適制御政策 『経済学の学び方考え方』 中央経済社 (1977)
- [1] 基準化正規CP指数による業種別景気分析 Discussion Paper