

## 研究業績（和文）

刈屋武昭

- 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
- 共著者
- 『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）J I C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M P T (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M T V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M T V連関分析 (1990) 『経済研究』
- [22] 地域経済動向M T V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C P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) 『E S P 6月号』
- [17] M T V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M T V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係る調査』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D I (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O L S EとG L S E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] 2 S L S E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