

## 【著者紹介】

伊藤 隆康（いとう たかやす）

現職 新潟大学経済学部教授

生年 1960年

最終学歴 筑波大学大学院経営・政策科学研究科博士課程修了  
博士（経営学）（筑波大学）、博士（経済学）（新潟大学）

主要職歴 1984年4月～1988年3月 東海銀行  
1988年4月～2003年3月 共同通信社  
2003年4月～現在 新潟大学

主な著書、論文

著書

- (a) 『Interest Rates and Monetary Policy in Japan』単著，2005.3，NUSS :Niigata University Scholars Series,Vol.2.
- (b) 『長期金利と中央銀行-日本における金利の期間構造分析』，単著，2005.10，日本評論社.
- (c) 『金融・会計のビジネス数理』（近刊）分担執筆，筑波大学ビジネス科学研究科編，朝倉書店.

論文

- (a) 「金利の期間構造分析-日銀の金融政策の効果と限界」単著2000.3『現代ファイナンス』NO.7, pp.75-90.
- (b) 「金利スプレッドのインフレ指標性に関する分析」単著2002.5『証券経済学会年報』第37号, pp.25-34.
- (c) 「日本におけるフィッシャー仮説の検証-金利の期間構造全体を利用して」単著2003.3『金融経済研究』第19号, pp.1-14.
- (d) 「日銀の金融政策の分析-翌日物金利の誘導水準変更が市場金利に与える影響」単著2003.9『金融経済研究』第20号, pp.53-63.
- (e) 「東京都における預金金融機関の店舗配置と競合」単著，2004.9『生活経済学研究』第20巻, pp.113-126.
- (f) 「The Analysis of Interest Rate Swap Spreads in Japan」単著，forthcoming *Applied Financial Economics Letters*.

大橋 和彦（おおはし かずひこ）

現職 一橋大学大学院国際企業戦略研究科助教授

生年 1963年

最終学歴 MIT スローン経営大学院博士課程修了経営学（ファイナンス）博士号（Ph.D.）取得

主要職歴 1994年 筑波大学講師社会学系  
1996年 一橋大学商学部専任講師  
1998年 一橋大学商学部助教授  
1999年 一橋大学大学院国際企業戦略研究科助教授

主な著書、論文

“ A structural model for electricity prices with spikes: Measurement of spike risk and optimal policies for hydropower plant operation, ” (2006), Forthcoming in Energy Economics, (Co-authored with Takashi Kanamura)

“ Security Innovation on Several Assets under Asymmetric Information, ” (1999), Japanese Economics Review, Vol. 50, pp. 76-96

“ Optimal Futures Innovation in a Dynamic Economy - The Discrete Time Case -, ” (1997), Journal of Economic Theory, Vol. 74, pp. 448-465

“ Endogenous Determination of the Degree of Market-Incompleteness in Futures Innovation ” (1995), Journal of Economic Theory, Vol. 65, pp. 198-217

「パイアウトファンド」(2004)(松木伸男、本多俊毅との共著)中央経済社

「証券化の知識」(2001)日経文庫887/A44 日本経済新聞社

金村 宗(かなむら たかし)

現職 電源開発(株)

生年 1971年

最終学歴 一橋大学大学院国際企業戦略研究科修士課程修了、博士号取得(金融戦略)

主要職歴 1997年 電源開発(株)

主な著書、論文

“ A structural model for electricity prices with spikes: Measurement of spike risk and optimal policies for hydropower plant operation, ” (2006), Forthcoming in Energy Economics, (Co-authored with Kazuhiko OHASHI)

高見 茂雄(たかみ しげお)

現職 富山大学経済学部教授

生年 1955年

最終学歴 東京工業大学大学院 社会理工学研究科 経営工学専攻 博士後期課程退学

主要職歴 1979年より、さくら銀行(現在三井住友銀行)にて、デリバティブトレーディング、資産担保証券組成など、証券・国際業務に従事。1999年より、(株)グロービスにて、ファイナンス分野ファカルティーに従事。2002年より現職。

主な著書、論文

共著 「IPO 企業価値評価において重視される企業特性」平成14年6月、経営財務研究、Vol.22, No.1, pp.50-64.

単著 「投資意思決定におけるリスク把握と測定方法」平成15年6月、管理会計学、第11巻、1号, pp.15-24.

単著 「財務内容の改善が設備投資行動に与える影響」平成18年4月、管理会計学、第14巻、2号, pp.3-13.

単著 「減価償却の方法が設備投資予算編成に与える影響」平成18年5月、原価計算研究、

Vol.30, No.2, pp.10-19.

共著 「TOPIX 相場変動のニューラルネットによる可視化」平成18年6月, 経営財務研究, Vol.25, No.2, pp.50-68.

単著 「TOPIXの予測可能性・構造変化のない期間での線形モデルとニューラルネットモデルの適合度比較」平成18年7月, 証券アナリストジャーナル7月号, pp.84-96.

辰巳 憲一(たつみ けんいち)

現職 学習院大学経済学部教授

生年 1947年

最終学歴 米国ペンシルベニア大学大学院卒業

主な著書、論文

「ストラクチャード・ポートフォリオ・マネジメント入門」有斐閣、2005年。「金融・証券市場分析の理論」中央経済社、2004年。

「国際企業金融論」東洋経済新報社、1990年。

「日本の銀行業・証券業」東洋経済新報社、1984年。

中野 聖子(なかの しょうこ)

現職 一橋大学大学院経済学研究科博士後期課程

生年 1974年

最終学歴 博士課程単位取得

主要職歴 一橋大学経済研究所・リサーチアシスタント

東京大学大学院経済学研究科・リサーチアシスタント

経済産業研究所、経済産業省商務情報政策局商務課・リサーチアシスタント

経済産業省商務情報政策局商務課・法執行専門職

主な著書、論文

“ Impact Mitigation for Emergency Events : Their Effects on Day-ahead and Real Time Market Locational Based Marginal Pricing at the NewYork ISO ”

出版年 : 2005

発表誌 : 25TH USAEE/IAEE North American Conference Proceedings

出版社 : International Association for Energy Economics

原 千秋(はら ちあき)

現職 京都大学経済研究所 助教授

生年 1964年

最終学歴 米国ハーバード大学経済学博士(Ph.D.)

主要職歴 1993.10.1~1994.9.30 ロンドン大学ユニヴァーシティカレッジ(UCL)・経済学部・専任講師

1994.10.1~1995.9.30 ルーヴァンカソリック大学・CORE・研究員

1995.10.1～2004.3.31 ケンブリッジ大学・経済政治学部・専任講師

その間

1998.10.1～1999.9.30 神戸大学・経済経営研究所・助教授

2002.10.1～2003.9.30 一橋大学・経済研究所・助教授

2003.4.1～現在 京都大学・経済研究所・助教授

主な著書、論文

著書

(a) Solution Manual to Mas-Colell, Whinston, and Green's 'Microeconomic Theory,' Oxford University Press, 1997. Steve Tadelis および Ilya Segal との共著

(b) 『入門ミクロ経済学』2005年ダイヤモンド社 武隈慎一、金子浩一、丹野忠晋、小川浩、山重慎二との共著

論文

(a) "Commission-revenue maximization in a general equilibrium model of asset creation" *Journal of Economic Theory*, vol. 65, no. 1 (February 1995), pp. 28-298.

(b) "Welfare analysis of the coordinating role of a redundant security," *Economics Letters*, vol. 56, no. 3 (November, 1997), pp.299-303.

(c) "Transaction costs and a redundant security: Divergence of individual and social relevance," *Journal of Mathematical Economics*, vol. 30, no. 4 (May 2000), pp. 497-530.

(d) "The anonymous core of an exchange economy," *Journal of Mathematical Economics*, vol. 38, no. 4 (September 2002), pp. 91-116.

(e) "Existence of equilibria in economies with bads," *Econometrica*, vol. 73, no. 2 (March 2005), pp. 647-658

(f) "Bargaining set and anonymous core without the monotonicity assumption," *Journal of Mathematical Economics*, vol. 41, no. 4-5 (August 2005), pp. 545-556.

(g) "Risk-free Bond prices in incomplete markets with recursive multiple-prior utilities," 梶井厚志との共著. *International Journal of Economic Theory*, vol. 2, no. 2 (June 2006), pp. 135-157.

藤原 浩一（ふじわら こういち）

現職 同志社大学大学院ビジネス研究科 助教授

生年 1963年

最終学歴 慶應義塾大学大学院商学研究科博士課程修了

主要職歴 弘前大学人文学部、福島大学経済学部、助教授を経て現職

主な著書、論文

「板寄せにおける模索過程の分析」『先物取引研究』第1巻第1号 1（共著者：岩田暁一、砂田洋志、飯田仲衛、吉田淳）1995年6月。

“Continuously Traded Options on Discretely Traded Commodity Futures Contracts,” *The Journal of Futures Markets*, vol.17, No.6. (R.I.Webb, G.Iwata, H.Sunada) “1997年9月。「価格ボ

ラティリティと原油備蓄 - SWARCH, KERNEL モデルによる実証分析 - 」慶應義塾大学『三田商学研究』第42巻第5号（共著者：新関三希代、熊谷善彰）”1999年12月。

「クラック・スプレッドの安定性 - 原油価格と石油製品価格の共和分分析 - 」全国商品取引所連合会編『商品取引所論体系11』

2001年3月。

「スプレッド取引と共和分分析」全国商品取引所連合会編『商品取引所論体系12』2004年3月。

黄 孝春（こう こうしゅん）

現職 弘前大学人文学部 助教授

生年 1962年

最終学歴 京都大学大学院経済学研究科後期博士課程修了

主要職歴 弘前大学人文学部講師を経て現職

主な著書、論文

「戦前期日本における綿花輸入機構の変容とその理由」、弘前大学人文学部『人文社会論叢』社会科学編、創刊号、1999年3月。

「戦前期日本の綿業関係者による取引所利用の実態分析」、『先物取引研究』第5巻第1号、No. 9、2000年9月。

「戦後における繊維流通と取引所問題」、『先物取引研究』第7巻第1号、No.11、2002年12月。

林 学貴（りん がくき）

現職 日本学術振興会 特別研究員

生年 1965年

最終学歴 岩手大学大学院連合農学研究科博士課程修了

主要職歴 上海财经大学国際工商管理學院、中国商務省国際貿易研究院を経て現職

主な著書、論文

「人工的ニューラル・ネットワークによる金融予測」『中国博士後』2002年第1期。

「先物市場の国際競争と中国の対応策」『国際貿易』第276期、2004年12月。