

現代ファイナンス

2002年3月号 (No.11)

わが国銀行業の効率性の検討
フロンティア費用関数の推計を通じて
国方 明

金融派生市場の導入と原資産市場の流動性
日経平均株価先物取引の事例
井坂 直人

ストックオプションと株式所有権構造
阿萬 弘行

現代ファイナンス

2002年9月号 (No.12)

グローバル資産市場リターンの動学分析
中島 英喜

事業多角化と企業価値
平元 達也

忘れられた方程式：ブラック/ショールズの
オプション価格と投資家の選好
倉澤 資成

現代ファイナンス

2003年3月号 (No.13)

M&A 発表日の株価効果に関する要因分析

井上 光太郎 / 加藤 英明

株価指数の系列相関と規模別ポートフォリオの相互自己相関

祝迫 得夫

動学因子モデルに基づくグローバル資産市場のリターン予測

月次リターンの同時確率分布の事前推定

中島 英喜

現代ファイナンス

2003年9月号 (No.14)

確率的な金利変動と最適アセットアロケーション

小倉 誠 / 本多 俊毅

変額年金保険の評価

Valuing Variable Annuities

小林 孝雄 / 池田 亮一 / 長谷川 洋一郎

日本における新規株式公開に関する実証分析

山分 佐知子

大規模マクロショック後の流動性回復メカニズム

米国同時多発テロ直後の東京証券取引所

井坂 直人 / 斉藤 誠

現代ファイナンス

2004年3月号 (No.15)

空売り制約と株価の情報効率性
: 業績予想修正発表のイベント・スタディー
井坂 直人

株式持合いの解消のシグナリング・モデル
砂川 伸幸

天気晴朗ならば株高し
加藤 英明 / 高橋 大志

不完備市場における消費と資産価格の一考察
田中 敬一
