

経済論叢別冊

調査と研究

第27号

2003年10月

特集 金融工学のフロンティア

マルチンゲール法による最適消費/ ポートフォリオ選択問題の解法.....	岩 城 秀 樹 吉 川 大 介	1
VaR のバイアスと内挿・外挿による修正	乾 孝 治	19
債券市場におけるリスクプレミアムの分解.....	今 井 俊 夫	27
ポートフォリオの信用リスク計測モデル ——シミュレーションと解析的手法の融合——.....	室 町 幸 雄	43
フィルタリングと変分法を用いた Kyle モデルの分析	西 出 勝 正	53
独占市場におけるリアル・オプション分析 ——解析的アプローチ——.....	芝 田 隆 志 藤 原 哉	59

京 都 大 学 経 済 学 会