

集中講義 参考文献

2005 年 6 月 3 日 , 高岡浩一郎*

◇ 本

- [1] Lamberton, D. & B. Lapeyre, *Introduction to Stochastic Calculus Applied to Finance*. Chapman & Hall, 1996. (日本語版『ファイナンスへの確率解析』朝倉書店)
- [2] Steele, J.M., *Stochastic Calculus and Financial Applications*. (Applications of Mathematics, 45) Springer, 2000.
- [3] Elliot, R.J. & P.E. Kopp., *Mathematics of Financial Markets*. (Springer Finance) Springer, 1998.
- [4] 藤田岳彦『ファイナンスの確率解析入門』講談社 2002 年 .
- [5] Baxter, M. & A. Rennie, *Financial Calculus*. Cambridge Univ. Press, 1996. (日本語版あり) 数学科のセミナーには物足りないが, 副読本としては良いのでは。特に第 5 章の金利モデルの記述は素晴らしい。
- [6] Hull, J., *Options, Futures, and Other Derivatives*, Fifth edition. Prentice-Hall, 2002. (日本語版『フィナンシャルエンジニアリング』金融財政事情研究会) 数学科の本ではないが, 金融工学の世界で「バイブル」と呼ばれているだけあって, 様々な分野をよくカバーしている。
- [7] Musiela, M. & M. Rutkowski, *Martingale Methods in Financial Modelling*. Applications of Mathematics vol. 36, Springer, 1997. 数学科のセミナーでも使えるレベルだが, 分厚すぎてやや不向き。しかし記述は明快で, 様々な分野をよくカバーしている。また発行年までの References が完璧に近いので, この本での記述を基にいろいろ論文にあたっていくという使い方をすれば, とても役立ちそう。
- [8] Karatzas, I. & S.E.Shreve, *Methods of Mathematical Finance*. (Applications of Mathematics, 39), Springer 1998. 連続時間について, がっちりした記述。
- [9] 宮原孝夫『株価モデルとレヴィ過程』朝倉書店 2003 年.
- [10] 楠岡・青沼・中川『クレジット・リスク・モデル 評価モデルの実用化とクレジット・デリバティブへの応用』金融財政事情研究会 2001 年.
- [11] ボイル『はじめてのデリバティブ』今井潤一訳, 日本経済新聞社 2002 年.

*一橋大学大学院商学研究科 . Email: takaoka@math.hit-u.ac.jp

- [12] パートン・マルキール『ウォール街のランダム・ウォーカー』井手 訳, 日本経済新聞社 1999 年.
- [13] 『マネー革命』第 1 ~ 3 巻. NHK 1999 年.
- [14] グロービス・マネジメント・インスティテュート『MBAファイナンス』ダイヤモンド社 1999 年.
- [15] 住友信託銀行編『デリバティブキーワード 280』金融財政事情研究会(きんざい) 2000 年.

◇ 価格付け理論の初期の論文

- [16] Black, F. & M. Scholes, The pricing of options and corporate liabilities. *J. Political Economy* **81** (1973), 637–659.
- [17] Cox, J.C., S.A. Ross & M. Rubinstein, Option pricing: a simplified approach. *Journal of Financial Economics* **7** (1979), 229–263.
- [18] Harrison, J.M. & D.M. Kreps, Martingales and arbitrage in multi-period securities markets. *J. Econom. Theory* **20** (1979), 381–408.
- [19] Harrison, J.M. & S.R. Pliska, Martingales and stochastic integrals in the theory of continuous trading. *Stochastic Processes and Their Applications* **11** (1981), 215–260.
- [20] ———, A stochastic calculus model of continuous trading: complete markets. *Stochastic Processes and Their Applications* **15** (1983), 313–316.

◇ 新種のオプションの価格計算

- [21] Akahori, J., Some formulae for a new type of path-dependent option. *Annals of Applied Probability* **5** (1995), 383–388.
- [22] Yor, M., M. Chesney, H. Geman & M. Jeanblanc-Picqué, Some combinations of Asian, Parisian and barrier options. 論文集 *Mathematics of Derivative Securities*, edited by M.A.H. Dempster & S.R. Pliska, Cambridge Univ. Press, 1997 の pp.61–87.
- [23] Nagayama, I., Pricing of passport option. *J. Math. Sci. Univ. Tokyo* **5** (1998), 747–785.

◇ 非完備(不完備)市場, その他

- [24] Föllmer, H. & P. Leukert, Quantile hedging. *Finance & Stochastics* **3** (1999), 251–273.
- [25] 関根 順, 不確定ボラティリティ下でのデリバティブの複製. 『数理科学』2000 年 8 月号, 44–49.
- [26] 森本祐司, 金融機関のリスク管理と数学. 『数学』(日本数学会の雑誌) 2000 年 7 月号 pp. 292–295.
- [27] ウェブサイト “Global Derivatives” <http://www.global-derivatives.com>