

辰巳憲一教授略歴ならびに著作目録

略 歴

1947年	大阪市生まれ,
1969年	大阪大学経済学部卒業,
1975年	米国ペンシルベニア大学大学院卒業。
1976, 79年	東京経済大学講師, 助教授,
1983年	東京経済大学教授,
1990年	学習院大学教授。

著作目録： 主要単著

『企業金融の新展開』時事通信社, 2015年。『ストラクチャード・ポートフォリオ・マネジメント入門～最新投資戦略の理論』有斐閣, 2005年。『金融・証券市場分析の理論～新しい展開と応用』中央経済社, 2004年。『ポートフォリオ・マネジメント/債券分析/デリバティブ(CIIA サブノート)』(社)日本証券アナリスト協会, 2004年。『株式分析/コーポレート・ファイナンス(CIIA サブノート)』(社)日本証券アナリスト協会, 2004年。『デリバティブと新金融商品の数学～問題と解答』東洋経済新報社, 1996年。『ゼミナール デリバティブと新金融商品の数学～基礎と応用』東洋経済新報社, 1995年。『アナリストのための 金融論』東洋経済新報社, 1993年。『アナリストのための 証券分析とポートフォリオ・マネジメント』有斐閣, 1991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。『日本の金融・資本市場』東洋経済新報社, 1982年。

最近の学術論文

Dynamics of Integration in East Asian Equity Markets, (with Komatsubara, T. and Okimoto, T.) RIETI Discussion Paper Series 16-E-084, August 2016.

Rational Theory of Information Security Battle: Economic Analysis of Preemptive Behavior, (with Goto, M.) Discussion Paper, Series A, 303: 1-31 Hokkaido University, June 2016.

“Determining anomalous dynamic patterns in price indexes of London Metal Exchange by data synchronization,” (with Miyano, T.) *Physica A* 391, November 2012, pp.5500-5511.

“The Theory of Optimal Investment in Information Security and Adjustment Costs: An Impulse Control Approach,” (with Goto, M.) pp.73-96 in *Recent Advances in Financial Engineering 2011*, Proceedings of International Workshop, edited by Takahasi, A., Muromachi, Y. and Nakaoka, H., World Scientific Publishing, 2012.

“Optimal Timing of Information Security Investment,” (with Goto, M.) in *Economics of Information Security and Privacy*, Moore, T., Pym, D. and Ioannidis, C. (eds.), Springer, 2010. (Chapter 11)

学外活動

協会セミナー，社内研修・官庁研修などの講師，日本大学大学院商学研究科講師，研究所客員研究員。

内外学会活動

討論者，座長・司会，プログラム委員。