

岸本 直樹 教授の略歴と主要研究業績

1955年1月31日生まれ

学歴

1978年3月 東京大学経済学部経済学科 卒業
1978年4月 東京大学経済学部経営学科 学士入学
1979年3月 東京大学経済学部経営学科 卒業
1982年1月 New York University Graduate school of Business Administration Doctoral Program 入学
1987年10月 New York University Graduate school of Business Administration Doctoral Program 修了

学位

1987年10月 Doctor of Philosophy (New York University Graduate school of Business Administration)

職歴

1979年4月 山一証券株式会社 社員（研修部付）（1979年5月まで）
1979年5月 山一証券経済研究所 所員（証券調査部資本市場課）（1979年12月まで）
1979年12月 山一証券経済研究所（ニューヨーク事務所）（1981年12月まで）
1986年9月 New York University Graduate School of Business Administration Instructor in Finance（1987年6月まで）
1987年7月 Duke University The Fuqua School of Business Assistant Professor（1991年12月まで）
1989年9月 Massachusetts Institute of Technology Sloan School of Management Visiting Scholar（1989年12月まで）
1991年12月 筑波大学社会工学系 講師（1998年9月まで）
1998年10月 筑波大学社会工学系 助教授（2001年3月まで）
2001年4月 法政大学経営学部 教授（現在に至る）
2007年9月 New York University Stern School of Business Visiting Scholar（2009年8月まで）

役職等

2004年4月 法政大学経営学研究科研究科長（2005年3月まで）

学会活動

American Finance Association 会員（1984年～2018年）
Society for Financial Studies 会員（1988年～2018年）
日本ファイナンス学会会員（1993年～現在）
日本金融・証券計量・工学学会会員（1996年～2015年）
Japanese Journal of Financial Economics Editor（1993年～1998年）

International Review of Finance Associate Editor (1998 年～ 2009 年)

賞罰

1985 年 9 月 Jules I. Bogen Fellowship

1988 年 5 月 Salomon Brothers Center Award

研究業績

著書：共著

『入門・証券投資論』, 有斐閣, 2019 年 12 月 (池田昌幸氏との共著)。

著書：分担執筆

第 17 章 “A Valuation of Contingent Claims Under interest Rate and Asset Price Uncertainty,” 『現代経済社会における諸問題 <第 1 巻>』, 東洋経済新報社, 1994 年 5 月。

論文

“Pricing of Asset-Linked Bonds Under Interest Rate Risk,” Ph.D. Dissertation, New York University, 1987.

“Pricing Contingent Claims Under Interest Rate and Asset Price Risk,” *Journal of Finance*, Vol.44, No.3 (1989).

“Pricing Path Dependent Securities Backed by a Pool of Heterogeneous Callable Bonds,” Proceedings of the 16th European Finance Association Annual Meetings, 1989.

“Pricing Path Dependent Securities by the Extended Binomial Tree,” Proceedings of the 17th European Finance Association Annual Meetings, 1990.

「債券先物のデュレーション公式」, 『現代ファイナンス』No.1 (1997 年 3 月), MPT フォーラム・日本ファイナンス学会。

「国債の価格変動とマコーレイのデュレーション」, 『現代ファイナンス』No.2 (1997 年 9 月), MPT フォーラム・日本ファイナンス学会, (河野修己氏との共著)。

“Securitization of Assets into Multiple Securities: an Option-Theoretic Valuation,” *Japanese Journal of Financial Economics* Vol.2, No.1 (1998 年 1 月)。

“Duration and Convexity of Coupon Bond Futures,” *Journal of Fixed Income* Vol.8, No.1 (1998 年 6 月)。

「A Simplified Approach to Pricing Path Dependent Securities」, 『多目的統計データバンク報告書』No.75 (1999 年 3 月), 筑波大学多目的データバンク。

“Pricing Path-Dependent Securities by the Extended Tree Method,” *Management Science* Vol.50, No.9 (2004 年 9 月)。

「住宅金融公庫償還履歴データを使った全額繰上げ償還とデフォルトの分析」, 『住宅金融フォーラム』第 2 号 (2006 年 10 月) (金 瑛晋氏, 松本眞理氏との共著)。

“Prepayment Behaviors of Japanese Residential Mortgages,” *Japan and the World Economy*, Vol.30 (2014 年 5 月) (金 瑛晋氏との共著)。

「日本の住宅ローン市場における全額繰上返済」, 『住宅土地経済』No.96 (2015 Spring) (金 瑛晋氏との共著)。