

竹内 明香 (たけうち あすか)

2011 年度 COE 研究員

専攻分野：ファイナンス，計量経済学

研究テーマ：ボラティリティの時系列分析，株価指数オプションの実証分析

学歴：

2001 年 3 月 東京都立大学経済学部業

2003 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程（経済理論・経済統計専攻）修了。
修士（経済学）

2007 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科博士課程（経済理論・経済統計専攻）修了。
博士（経済学）

職歴：

・常勤

2007 年 4 月 日本銀行金融研究所

2008 年 4 月 早稲田大学大学院商学研究科 助教（2011 年 3 月まで）

担当「計量分析」，「情報処理」，「ミクロ経済学」

「専門英語講読（経済）」，「専門英語講読（商学・貿易・金融）」

・非常勤

2003 年 11 月 一橋大学 21 世紀 COE プログラム RA（2007 年 3 月まで）

2006 年 4 月 神奈川大学経済学部「経済情報処理」非常勤講師（2007 年 3 月まで）

2008 年 10 月 千葉大学法経学部「統計学演習」非常勤講師（2011 年 3 月まで）

2010 年 4 月 一橋大学経済研究所非常勤研究員（現在に至る）

2010 年 10 月 日本大学大学院経済学研究科「金融工学」非常勤講師（2011 年 3 月まで）

2011 年 4 月 一橋大学経済研究所 グローバル COE 研究員（現在に至る）

2011 年 4 月 日本大学経済学部「計量経済学」非常勤講師（現在に至る）

研究業績：

・論文

Kanoh, S., and A. Takeuchi-Nogimori (2011), “An Analysis of Option Pricing in the Japanese Market,” 『産業経営』 No. 48. [査読あり]

竹内（野木森）明香・渡部敏明(2008)「日本の株式市場におけるボラティリティの長期記憶性とオプション価格」，『現代ファイナンス』No. 24, pp. 45-74 [査読あり]

竹内明香 (2006)「日経 225 オプション価格の実証分析～ARCH, ARCH-t, SV モデルによる比較」、『一橋経済学』第 2 号，一橋大学, pp. 187-208. [査読あり]

竹内明香 (2006)「日経 225 オプション価格差の自己相関分析」、『証券アナリストジャーナル』Vol. 44, No. 9, pp. 71-82. [査読あり]

三井秀俊・竹内明香 (2004) 「ヒストリカル・ボラティリティとインプライド・ボラティリティの予測精度に関する実証」, 『産業経営研究』26号, 日本大学産業経営研究所, pp.85-101

・著書:

加納悟・浅子和美・竹内明香 (2011) 「入門 経済のための統計学」, 第3版, 日本評論社.

竹内明香・加納悟 (2011) 「S&P500 コールオプションの市場価格と理論価格の差に関する実証分析」, ミネルヴァ書房, 浅子和美・渡部敏明編著『ファイナンス・景気循環の計量分析』第2章.

加納悟・竹内明香 (2005) 「わが国のオプション市場における価格付け誤差分析」, 日本評論社、倉沢資成『市場競争と市場価格』第6章, pp. 135~158

・学会報告:(上記の論文・著書以外)

竹内(野木森)明香 (2011)、「個別株式ボラティリティの長期記憶性と非対称性」、第5回日本統計学会春季集会

竹内(野木森)明香・小川真実・大鋸崇・中西雅之 (2010) , 「普通株式取得請求権付優先株式の価値評価」, 日本ファイナンス学会

・その他:

住宅総合センター(竹内明香・行武憲史) (2011) 「不動産市場のダイナミクスとマクロ経済環境の相互作用に関する分析」『(財)日本住宅総合センター平成21年度プロジェクト 不動産市場における需給メカニズム分析調査』

照会先

渡部敏明 (一橋大学経済研究所教授) 浅子和美 (一橋大学経済研究所教授)