髙見澤 秀幸

身分

教授

担当科目

証券市場論

最近の研究テーマ

金利と株式配当の期間構造のモデル化

主な著書・論文

- A Term Structure Model of Interest Rates with Quadratic Volatility, Quantitative Finance 18 (7), 1173-1198 (2018).
- Predicting Interest Rate Volatility Using Information on the Yield Curve, International Review of Finance 15 (3), 347-386 (2015).
- Modeling the Term Structure of Interest Rates with General Diffusion Processes: A Moment Approximation Approach, Journal of Economic Dynamics and Control 33 (1), 65-77 (2009) (with I. Shoji).
- Is Nonlinear Drift Implied by the Short-End of the Term Structure?, Review of Financial Studies 21 (1), 311-346 (2008).

研究室番号

2 号館 21202 号室

オフィスアワー

火曜日 13:00-14:00

研究室電話番号

042-674-3612