ふりがな　　くわな　よういち

氏 名　　**桑名 陽一**

## 1. 学歴

1985 年　3 月　東京大学教養学部教養学科相関社会科学分科卒業
1987 年　4 月　一橋大学大学院経済学研究科修士課程入学
1989 年　3 月　同修了
1989 年　4 月　同博士後期課程入学
1989 年　9 月　スタンフォード大学大学院統計学科博士課程入学
1992 年　9 月　一橋大学大学院経済学研究科博士後期課程退学
1994 年　1 月　スタンフォード大学大学院統計学科博士課程修了（Ph. D. in Statistics）

## 2. 職歴・研究歴

1985 年　4 月　日本経済新聞社（1987 年 3 月まで）
1994 年　4 月　一橋大学経済研究所非常勤講師（1994 年 10 月まで）
1994 年 10 月　一橋大学経済学部専任講師
1997 年　3 月　スタンフォード大学統計学科客員研究員（1999 年 3 月まで）
1998 年　4 月　一橋大学大学院経済学研究科専任講師
2000 年　4 月　一橋大学大学院経済学研究科助教授（2007 年 4 月より准教授）

## 3. 学内教育活動

### A. 担当講義名

#### （a）学部学生向け

上級統計学Ⅰ，確率論Ⅰ，確率・統計特論 B

#### （b）大学院

上級統計学Ⅰ，上級統計学Ⅱ，確率論Ⅰ，確率論Ⅱ，確率・統計特論 B，ワークショップ

### B. ゼミナール

学部後期，大学院

### C. 講義およびゼミナールの指導方針

学部 3･4 年次および大学院初年次向けの統計学・確率論の講義では，基礎力養成に重点をおくという観点から，先端のトピックスに終止することはせずに，考え方の展開を詳細にわたって解説するように心がけている。また，計量経済学を講義するときには，実証分析への応用に配慮して，現実の経済データを用いたコンピュータ実習を導入している。大学院生向けの専門講義では，研究テーマ選択の手助けとなることを期待して，最近の研究成果を取り入れた内容を提供するように努力している。学部 3 年生ゼミナールにおいては，数理統計学とそれを学ぶための確率論の基礎的テキスト（英文のもの）を輪講し，同時に問題演習をおこなっている。先人たちのアイデアに触れ，さまざまな現象が確率モデルとして定式化されることを知ってもらう。学部 4 年生に対しては，

各人の興味に応じて個別に卒業研究を指導している。大学院生ゼミでは，専門家および研究者育成という立場から，厳密性に重点をおいて最近の文献／論文講読を行っている。

## 4. 主な研究テーマ

(1)数理統計学 正規性・分布型の検定問題

(2)ファイナンスのための統計解析 高頻度時系列データの分析手法

(3)数理金融論 部分観測下の消費・投資決定問題

## 5. 研究活動

### A. 業績

#### (b) 論文(査読つき論文には*)

* "LBI Tests for Multivariate Normality in Exponential Power Distributions," *Journal of Multivariate Analysis*, Vol. 39, 1991 (with T. Kariya), pp. 117-134.

"Optimal Consumption/Investment Decisions with Partial Observations," Ph. D. dissertation, Stanford University, 1993.

* "Certainty Equivalence and Logarithmic Utilities in Consumption/Investment Problems," *Mathematical Finance*, Vol. 5, No.4, 1995, pp. 297-309.

"An Extension of Krylov's Approach to Stochastic Solutions: The Space LE," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol. 36, No. 2, 1995, pp. 219-234.

「マクロモデルを作ろう」『一橋論叢』第 115 巻第 4 号，1996 年，28-49 頁。

"Optimal Consumption/Investment Decisions in Markovian Dynamic Systems," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol. 38, No. 2, 1997, pp. 149-166.

「部分観測下の投資／消費決定問題におけるベイズ解の明示的表現について」『一橋大学研究年報経済学研究』No. 41，1999 年，173-208 頁。

"A Minimax Analysis of Mertons Problem," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol. 40, No. 2, 1999, pp. 123-128.

*「ニュースと外国為替市場」(須齋正幸氏と共著)『九州経済学会年報』第 37 集，1999 年，30-35 頁。

*「マクロ経済指標の公表が外国為替市場に与える影響」(須齋正幸，川崎能典氏と共著)『統計数理』第 48 巻第 1 号，2000 年，213-227 頁。

#### (c) 翻訳

『資産価格の理論 株式・債券・デリバティブのプライシング』ダレル・ダフィー著(山崎，大橋，本多氏と共訳)創文社，1998 年，445 頁。