

伊藤 有希
ITOH Yuki

■ 専門分野

経営システム科学分野・計量ファイナンス

■ 指導可能な研究テーマ

統計学及び確率論的アプローチを用いた金融市場，証券，金融リスクに関する研究

■ 過去に指導した学生の修士論文題目

■ 修士論文作成のための必読文献リスト

- ▶ Capinski, Marek and Tomasz Zastawniak (2010) *Mathematics for Finance: An Introduction to Financial Engineering*, 2nd edition, Springer.
- ▶ 木島正明・鈴木好輝・後藤允 (2012) 『ファイナンス理論入門: 金融工学へのプロローグ』, 朝倉書店, 2012.
- ▶ Wooldridge, Jeffrey M. (2019) *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 7th edition, South-Western Pub.
- ▶ 鹿野繁樹 (2015) 『新しい計量経済学 データで因果関係に迫る』 日本評論社.

■ 修士論文作成に向けた履修推奨科目

経営財務特論

計量分析特論

リスク管理 (YBS 科目)

エコノメトリクス (YBS 科目)

統計データ分析 (学部・全学教育科目)

■ 博士課程後期での研究指導実績

【過去に指導した学生の博士論文題目 (学位取得年月)】

Default or Exit?: Empirical Study on SMEs in the Japanese Construction Industry (2015 年 3 月)

■ その他