

小峰みどり氏の略歴と仕事

略 歴

- 1948年4月15日 千葉県木更津市にて生まれる
 1967年3月 神奈川県立横浜平沼高等学校卒業
 1971年3月 津田塾大学学芸学部数学科卒業
 同年4月 (財)日本証券経済研究所入所
 1981年～1982年 米国ワシントン大学経済学部留学
 1987年11月～ (財)日本証券経済研究所主任研究員
 1987～1996年 立正大学経済学部非常勤講師
 1994年～ 横浜国立大学経済学部非常勤講師
 1989年10月～ 「証券アナリストジャーナル」編集委員
 1991年6月～ (財)津田塾会監事
 1993年6月～ 日本金融・証券計量・工学学会評議員
 および同学会英文機関誌アソシエイトエディター
 1996年4月～ 証券投資信託協会投信懇話会委員
 1996年7月6日 逝去(享年48歳)

著 書

- 『アナリストのための数学入門』 ビジネス教育出版社 1989年

共著・訳書等

- 『市場の効率性について』(証券アナリスト通信教育テキスト)
 日本証券アナリスト協会 1980～1991年
 『現代証券市場分析』 東洋経済新報社 1986年6月
 『証券アナリストのための数学・統計学』(証券アナリスト通信教育テキスト)
 日本証券アナリスト協会 1992年～
 『株式投資入門』 経済法令研究会 1993年1月
 『現代経済と証券市場』 有斐閣 1994年6月

証券経済研究 第6号 (1997.3)

『証券市場分析の基礎』(E. F. Fama 著, 共訳)
 (財)日本証券経済研究所 1979年

主要論文

「証券分析がポートフォリオ・セレクションに与える影響」(Treyner & Black 論文の解説と全訳)
 『計測:資料』No. 6 1974年5月

「株式市場における収益と危険—わが国証券市場の数量的分析—」
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 41 1977年2月

「東証株価指数の配当修正済数値の計測」
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 44 1978年5月

「わが国金融政策の波及経路—株式市場, コール市場, 及び銀行貸出市場の分析—」(共同論文)
 『東京経大会誌』No. 108 1978年9月

「米国における1980年代金融市場の予測—ニューヨーク大学グループの作業について—」
 『計測室テクニカル・ペーパー』No.47 1979年8月

「フェア・ゲーム・モデルによる株式市場の効率性の検定(1) (2) (3)」
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 35, No. 44, No. 51
 1975年7月~1980年7月

「均衡価格理論」(『現代証券事典』第Ⅱ編, 第1章 [3])
 日本経済新聞社 1981年12月

“The Effect of Inflation on Common Stocks”
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 57 1982年12月

“Time Series Analysis of Stock Prices in the Tokyo Stock Exchange”
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 57 1982年12月

“Forecasting of Yields of Corporate AAA Bonds (FYAAAC)”
 『計測室テクニカル・ペーパー』No. 57 1982年12月

「金融先物市場の機能」 『ファイナンス研究』No. 2 1984年11月

「債券価格の決定と直利指向」 『ファイナンス研究』No. 4 1985年12月

「株価指数先物取引及びオプション取引に関する研究の中間報告」
 『証券資料』No. 96 1987年5月

「暴落とリスク・コントロール手法」
 『証券資料』No. 104 1989年3月

「わが国債券市場固有の現象と期間構造分析」(共同論文)
 『大蔵省財政金融研究所フィナンシャル・レビュー』第14号
 1989年10月

「債券価格の理論」(『新版現代証券事典』第Ⅱ編・第2章 [5])
 日本経済新聞社 1992年7月

「証券市場及び証券業の将来像に関する研究会報告書」 1993年8月

「ディーリング業務は証券会社の活性剤となりうるか」
 『証券レビュー』第34巻7号 1994年7月

「証券業務の収益性を考える」 『証券レビュー』第34巻11号 1994年11月

「データで見る証券・金融市場の構造変化」(共著)
 『証券資料』No. 125 1995年3月

「デリバティブ・リスク管理のキーポイント」
 『証券レビュー』第35巻第4号 1995年4月

「ROE は正しく理解されているか」
 『証券レビュー』第36巻第4号 1996年4月

学会発表

証券経済学会第17回全国大会 (1980年6月於神戸大学)

「無償増資に対する株価の反応」

証券経済学会第22回全国大会 (1984年8月於北海道大学)

「金融先物市場の機能」

証券経済学会第101回関東部会 (1989年10月於日本証券経済研究所)

「わが国債券市場固有の現象と期間構造分析」

証券経済学会第33回全国大会 (1990年5月於慶應義塾大学)

「裁定取引と株価変動」

報告書 (共同執筆)

「昭和60年度の証券市場」 日本証券経済研究所 1979年5月

「昭和60年代半ばの証券市場および証券業」
 日本証券経済研究所 1983年12月

「債券先物取引に関する研究の中間報告」
 日本証券経済研究所 1983年11月

「証券会社のデリバティブ取引に関する環境整備のあり方」
 日本証券経済研究所 1995年7月

講演・セミナー等

「債券の期間構造について」住友信託銀行	1986年
「債券市場に関する分析研究会」(主査)大蔵省財政金融研究所	1988~1989年
「クォンツ」シグマインベストメント・スクール	1989年
「文系のための数学入門」シグマインベストメント・スクール	1990年
「証券アナリスト養成講座」太陽投信委託	1989, 1990, 1991年
「先物およびオプション市場に関する研究会」(主査)大蔵省財政金融研究所	1990~1991年
「ファンドマネージャー養成コース」山一証券	1990~1992年
「年金基金のための数理」日本公社債研究所	1990, 1992, 1993年
「債券投資分析の基礎」日本生産性本部経営アカデミー経営財務コース	1990年
「ALMのための債券分析とタームストラクチャー」シグマインベストメント・スクール	1991年
「債券分析の基礎」(講師)金融財政事情研究会	1992年
「オプション理論における確率論の基礎」SRA (Software Research Associates, Inc.)	