

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2024年4月	Vol.36No.04	日経225オプションのVolatility surfaceを見る	リサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社 取締役 猪田 義浩
2024年3月	Vol.36No.03	日経225先物, 日経225mini, 日経225マイクロ先物の注文不均衡とリターン	東京経済大学 経営学部 教授、統計数理研究所 客員教授 吉田 靖
2024年2月	Vol.36No.02	英語論文 (要約)オプションプライシングにおける強マルコフ性について(2) (本編)THE STRONG MARKOV PROPERTY APPLIED TO OPTION PRICING PART II	京都大学経済学研究科 江上 雅彦
2024年1月	Vol.36No.01	英語論文 (要約)オプションプライシングにおける強マルコフ性について(1) (本編)THE STRONG MARKOV PROPERTY APPLIED TO OPTION PRICING PART I	京都大学経済学研究科 江上 雅彦
2023年12月	Vol.35No.12	日経平均株価指数オプションをもとに算出したテールリスク指標について	日本取引所自主規制法人 売買審査部 脇屋 勝 大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2023年11月	Vol.35No.11	日経225マイクロ先物とミニオプションの上場に寄せて —(2)日経225ミニオプション上場について—	公益財団法人 日本証券経済研究所 主席研究員(滋賀大学名誉教授) 二上 季代司
2023年10月	Vol.35No.10	日経225マイクロ先物とミニオプションの上場に寄せて —(1)先物ラージ・ミニ・マイクロの比較—	公益財団法人 日本証券経済研究所 主席研究員(滋賀大学名誉教授) 二上 季代司
2023年9月	Vol.35No.09	株価と商品先物価格の共変動:金融市場化と危機の影響	武蔵大学 大野 早苗
2023年8月	Vol.35No.08	コロナ禍以降の商品先物価格に対する地政学リスクと流動性への影響	武蔵大学 大野 早苗
2023年7月	Vol.35No.07	デリバティブ取引と金融リテラシー	神戸大学経済経営研究所教授 家森 信善
2023年6月	Vol.35No.06	日次情報による取引コストの計測	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2023年5月	Vol.35No.05	NUTSによる長期記憶を持つ非対称SVモデルのベイズ推定(第2回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2023年4月	Vol.35No.04	NUTSによる長期記憶を持つ非対称SVモデルのベイズ推定(第1回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2023年3月	Vol.35No.03	注文不均衡のクロスインパクト	法政大学経営学部 高橋 慎
2023年2月	Vol.35No.02	株価指数価格変動と現物・先物取引活動の関係の実証分析	高千穂大学商学部 柴田 舞
2023年1月	Vol.35No.01	株価指数先物取引の理論モデルに基づく価格付け分析	高千穂大学商学部 柴田 舞
2022年12月	Vol.34No.12	経済の不確実性と日本企業のデリバティブ利用 その2	国士舘大学 経営学部 顔 菊馨 一橋大学大学院 経営管理研究科 安田 行宏
2022年11月	Vol.34No.11	経済の不確実性と日本企業のデリバティブ利用 その1	国士舘大学 経営学部 顔 菊馨 一橋大学大学院 経営管理研究科 安田 行宏

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2022年10月	Vol.34No.10	マルコフ・スイッチング VAR モデルによる日経平均 VI と日経平均株価の連動性の分析	東洋大学経営学部 里吉 清隆
2022年9月	Vol.34No.09_2	エネルギーの先物取引(3) ～LNG 先物取引～	早稲田大学法学学術院教授 尾形 祥
	Vol.34No.09_1	英語論文 (要約)ファイナンス工学的見地による株式市場におけるドローダウンについて(2) (本編)A FINANCIAL ENGINEERING VIEW OF DRAWDOWNS IN THE STOCK MARKET PART II	京都大学経済学研究科 江上 雅彦
2022年8月	Vol.34No.08	英語論文 (要約)ファイナンス工学的見地による株式市場におけるドローダウンについて(1) (本編)A FINANCIAL ENGINEERING VIEW OF DRAWDOWNS IN THE STOCK MARKET PART I	京都大学経済学研究科 江上 雅彦
2022年7月	Vol.34No.07	日経平均ボラティリティ・インデックスのプライシングとボラティリティ・リスクプレミアム	甲南大学 経済学部 石田 功
2022年6月	Vol.34No.06	GARCH 型モデルによるボラティリティ指数の価格付け	甲南大学 経済学部 石田 功
2022年5月	Vol.34No.05	オプションの残存期間とボラティリティ・インデックスの算出	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2022年4月	Vol.34No.04	日経平均先物市場の市場の質の計測	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2022年3月	Vol.34No.03	エネルギーの先物取引(2) ～電力先物取引～	甲南大学法学部教授 山本 真知子
2022年2月	Vol.34No.02	エネルギーの先物取引(1) ～原油先物取引～	早稲田大学法学学術院教授 尾崎 安央
2022年1月	Vol.34No.01	異質リスクの総合化(2) ——証券・商品の総合取引所——	公益財団法人 日本証券経済研究所 主席研究員(滋賀大学名誉教授) 二上 季代司
2021年12月	Vol.33No.12	異質リスクの総合化(1) ——証券・商品の総合取引所——	公益財団法人 日本証券経済研究所 主席研究員(滋賀大学名誉教授) 二上 季代司
2021年11月	Vol.33No.11	日経平均先物と TOPIX 先物のハミルトニアン・モンテカルロ法による安定分布のベイズ推定(第2回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2021年10月	Vol.33No.10	日経平均先物と TOPIX 先物のハミルトニアン・モンテカルロ法による安定分布のベイズ推定(第1回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2021年9月	Vol.33No.09	金価格はどのように決まるのかー再考ー	武蔵大学経済学部教授 茶野 努
2021年8月	Vol.33No.08	JEPX スポット市場のリスクヘッジを可能にする TOCOM の電力先物市場のあり方	兵庫県立大学国際商経学部教授 草薙 真一
2021年7月	Vol.33No.07	2020 年度冬季における JEPX スポット市場価格高騰の要因分析	兵庫県立大学国際商経学部教授 草薙 真一
2021年6月	Vol.33No.06	コモディティ・デリバティブ市場の現状と課題 —総合取引所誕生からの1年を振り返る—	神戸大学経済経営研究所教授 家森 信善

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2021年5月	Vol.33No.05	可読性の高い解釈可能なモデルによるAIトレーダーの説明	株式会社かんぽ生命保険 運用企画部 運用計画担当 石原 龍太
2021年4月	Vol.33No.04	日経225先物、日経225mini、TOPIX先物の先行遅行関係の推計	東京経済大学 経営学部 教授 吉田 靖
2021年3月	Vol.33No.03	新型コロナウイルス禍での日経平均株価のボラティリティと分散リスクプレミアム(2)	一橋大学経済研究所教授 渡部 敏明
2021年2月	Vol.33No.02	新型コロナウイルス禍での日経平均株価のボラティリティと分散リスクプレミアム(1)	一橋大学経済研究所教授 渡部 敏明
2021年1月	Vol.33No.01	日経平均 VI 先物のハミルトニアン・モンテカルロ法によるベイズ時系列分析(第2回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2020年12月	Vol.32No.12	日経平均 VI 先物のハミルトニアン・モンテカルロ法によるベイズ時系列分析(第1回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2020年11月	Vol.32No.11	市場価格急変予兆の検出について:応用編	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2020年10月	Vol.32No.10	市場価格急変予兆の検出について	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2020年9月	Vol.32No.09	価格インパクトを考慮した取引執行問題II: 均衡取引執行戦略	大阪大学大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター[兼任] 大西 匡光 大阪大学大学院経済学研究科博士後期課程 学術振興会特別研究員 下清水 慎
2020年8月	Vol.32No.08	価格インパクトを考慮した取引執行問題I: 最適取引執行戦略	大阪大学大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター[兼任] 大西 匡光 大阪大学大学院経済学研究科博士後期課程 学術振興会特別研究員 下清水 慎
2020年7月	Vol.32No.07	金融リテラシーの高さと金融行動 —借入行動と証券投資—	神戸大学経済経営研究所教授 家森 信善 名古屋学院大学准教授 上山 仁恵
2020年6月	Vol.32No.06	若者の金融リテラシーと学校における金融経済教育 —新しい学習指導要領の円滑な導入に協力を—	神戸大学経済経営研究所教授 家森 信善
2020年5月	Vol.32No.05	商品先物のファンダメンタル価値と投資家行動	神戸大学 岩壺 健太郎 国際教養大学 Clinton Watkins
2020年4月	Vol.32No.04	東京市場とNY市場におけるプラチナと金の日中季節性	神戸大学 岩壺 健太郎 国際教養大学 Clinton Watkins 湖南師範大学 徐 涛
2020年3月	Vol.32No.03	ハミルトニアン・モンテカルロ法による非対称SVモデルの推定 -日経225先物、TOPIX先物- (第2回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2020年2月	Vol.32No.02	ハミルトニアン・モンテカルロ法による非対称SVモデルの推定 -日経225先物、TOPIX先物- (第1回)	日本大学経済学部 戸塚 英臣 日本大学経済学部 三井 秀俊
2020年1月	Vol.32No.01	感度分析によるAIトレーダーの投資判断アルゴリズムの解釈	株式会社かんぽ生命保険 運用企画部 運用リスクマネジメント担当 石原 龍太
2019年12月	Vol.31No.12	インプライド・ボラティリティの数理	大阪大学大学院基礎工学研究科

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
			深澤 正彰
2019年11月	Vol.31No.11	ボラティリティ指数の理論	大阪大学大学院基礎工学研究科 深澤 正彰
2019年10月	Vol.31No.10	価格インパクトの日中変動	法政大学経営学部 高橋 慎
2019年9月	Vol.31No.09	日経225オプションを用いた下方ジャンプ変動の計測	明治学院大学経済学部 生方 雅人
		デリバティブ市場 上場30周年 ～AIビジネス進化の影響を探る～	岡三証券グループ 森本 敏喜
2019年8月	Vol.31No.08	株価指数オプション取引30周年によせて 3. 株価指数オプション取引の足跡とデリバティブ市場の使命	大阪大学名誉教授 仁科 一彦
2019年7月	Vol.31No.07	株価指数オプション取引30周年によせて 2. オプション取引の特性と歴史	大阪大学名誉教授 仁科 一彦
2019年6月	Vol.31No.06	株価指数オプション取引30周年によせて 1. 株価指数オプション取引開始にいたる世界の金融経済情勢	大阪大学名誉教授 仁科 一彦
2019年5月	Vol.31No.05	GARCHオプション価格の閉じた解の考察	日本大学経済学部教授 三井 秀俊
2019年4月	Vol.31No.04	局所リスク中立性によるオプション評価の考察	日本大学経済学部教授 三井 秀俊
2019年3月	Vol.31No.03	アルゴリズム取引の問題点と今後の課題	首都大学東京大学院経営学研究科 足立 高德
2019年2月	Vol.31No.02	日経平均ボラティリティ・インデックスの現物と先物の関係 ―期待仮説による実証分析―	高千穂大学商学部 柴田 舞
2019年1月	Vol.31No.01	周波数分解された分散リスク・プレミアムの予測力	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2018年12月	Vol.30No.12	Random Forestを用いたESG情報による信用格付予測モデル構築の提案とCDS市場分析への応用可能性の検討	ニッセイアセットマネジメント 運用戦略部 ファイナンステクノロジー運用室 シニア・ポートフォリオ・マネジャー/中央大学大学院 理工学研究科 確率解析・金融工学・保険数理研究室 東出 卓朗
2018年11月	Vol.30No.11	日経225先物のリターン、ボラティリティ、出来高の日中周期性	一橋大学経済研究所教授 渡部 敏明
2018年10月	Vol.30No.10	デリバティブ学習における「OSE先物・オプション シミュレーター」の活用	(株)シンプレクス・インスティテュート代表取締役 伊藤 祐輔
2018年9月	Vol.30No.09	日経225先物市場における価格変動の分析: ナイト・セッションと日中立会	東洋大学経営学部 里吉 清隆
2018年8月	Vol.30No.08	株価指数先物取引30周年 3. 先物取引等の金融デリバティブの発展	大阪大学名誉教授 仁科 一彦
2018年7月	Vol.30No.07	株価指数先物取引30周年 2. 先物取引30年間の足跡とその影響	大阪大学名誉教授 仁科 一彦

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2018年6月	Vol.30No.06	株価指数先物取引30周年 1. 先物取引開始にいたる経済環境と主要な関連要因	大阪大学名誉教授 仁科 一彦
2018年5月	Vol.30No.05	日経平均ボラティリティの日内季節性	甲南大学経済学部 石田 功
2018年4月	Vol.30No.04	非対称確率的分散変動モデルによる日経225先物の分析	日本大学経済学部教授 三井 秀俊
2018年3月	Vol.30No.03	J-GATE稼働と日経225先物市場の日中流動性	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 高橋 慎
2018年2月	Vol.30No.02	人工知能による日経平均ボラティリティー・インデックスの予測	あすかアセットマネジメント株式会社 南 正太郎
2018年1月	Vol.30No.01	株価指数先物 上場30周年 ～AI運用の期待～	岡三証券グループ 森本 敏喜
2017年12月	Vol.29No.12	ボラティリティ・スプレッド	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 大屋 幸輔
2017年11月	Vol.29No.11	相場操縦防止策としての取引制度設計	東京理科大学経営学部 大橋 賢裕
2017年10月	Vol.29No.10	高頻度取引に対応したtobit型ACDモデル	株式会社ライトストーン/専修大学経済学研究科 高 英模
2017年9月	Vol.29No.09	配当指数先物と株価指数の関係性	野村証券株式会社 金融工学研究センター クオンツ・リサーチ部 大西 裕子
2017年8月	Vol.29No.08	日中売買データから示唆される日経平均の現先間裁定取引の存在可能性について	(株)三菱UFJトラスト投資工学研究所 川口 宗紀
2017年7月	Vol.29No.07	日経225先物のヘッジ比率の予測について	創価大学経済学部教授 浅井 学
2017年6月	Vol.29No.06	欧米個人投資家のデリバティブ取引	野村総合研究所 金融コンサルティング部 主任コンサルタント 飯野 正文
2017年5月	Vol.29No.05	日銀の国債買入れと国債の現物および先物市場の流動性・効率性	神戸大学 岩壺 健太郎 大阪取引所 太子 智貴
		「三度目の正直？」～AIがもたらす変革、デリバティブ取引の再認識へ～	岡三証券グループ 森本 敏喜
2017年4月	Vol.29No.04	大阪取引所で取引される国内株価指数先物	専修大学 経営学部 准教授 佐々木 浩二
2017年3月	Vol.29No.03	高速取引が日経平均先物市場の価格発見に与える影響	長崎大学経済学部 教授 森保 洋
2017年2月	Vol.29No.02	アントレプレナー・ファイナンスにおけるリアル・オプションの研究動向	岐阜聖徳学園大学経済情報学部 准教授 高橋 陽二
2017年1月	Vol.29No.01	ARCH型モデルの応用による日経225オプションの実証分析に関するサーベイ	日本大学経済学部 教授 三井 秀俊
2016年12月	Vol.28No.12	マイナス金利環境下のデリバティブ評価について	有限責任監査法人トーマツ 木村 学

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2016年11月	Vol.28No.11	日経 225 分散リスク・プレミアムの予測力	一橋大学経済研究所教授 渡部 敏明
2016年10月	Vol.28No.10	日経 225 先物と日経 225mini の切断実現ボラティリティの推定	東京経済大学 経営学部教授 吉田 靖
2016年9月	Vol.28No.09	経済指標・金融政策の公表が日本国債先物の日中流動性に与える影響	日本銀行 土田 直司・吉羽 要直 一橋大学 渡部 敏明
2016年8月	Vol.28No.08	日経平均スポット・ボラティリティ日次パスの関数 ARCH モデリング	甲南大学 経済学部 石田 功
2016年7月	Vol.28No.07	リーマン・ショック後のデリバティブ取引規制Ⅱ -OTC デリバティブの規制の在り方-	東京国際大学 教授 渡辺 信一
2016年6月	Vol.28No.06	日経 225 現先間裁定に関する考察	福山大学 経済学部 高阪 勇毅
2016年5月	Vol.28No.05	裁定取引に伴う現物株の取引データと日経平均先物超過需要関数の推定	明海大学 経済学部 新井 啓
2016年4月	Vol.28No.04	注文フロー不均衡と価格インパクト	大阪大学 大学院経済学研究科 数理・データ科学教育研究センター 高橋 慎
2016年3月	Vol.28No.03	中国株価指数先物のボラティリティ・ジャンプ	对外経済貿易大学 西村 友作 九州産業大学 船岡 健太
2016年2月	Vol.28No.02	短期的な市場変動予測指標としての VPIN の有効性について	株式会社大阪取引所 情報サービス室 脇屋 勝 大阪大学大学院 経済学研究科(兼)数理・データ教育研究センター 金融・保険部門 大屋 幸輔
2016年1月	Vol.28No.01	量的質的金融緩和と国債市場の流動性	神戸大学 経済学研究科 岩壺 健太郎
2015年12月	Vol.27No.12	銀行等のデリバティブエクスポージャーの計算方法の見直し	有限責任監査法人トーマツ 飯野 直也
2015年11月	Vol.27No.11	日経 225 先物のブル・ベア相場の分析	日本大学経済学部 教授 三井 秀俊
2015年11月 特別号	Vol.27No.11 特別号	JPX 日経インデックス 400 先物取引の取引状況 - 更なる市場拡大に向けて	大阪取引所 市場企画部 調査役 今村 文彦
2015年10月	Vol.27No.10	EBS 外国為替指値市場におけるキャンセル行動の分析	滋賀大学 経済学部 ファイナンス学科 教授 吉田 裕司
2015年9月	Vol.27No.09	日経 225 先物はジャンプしているか?	東京経済大学 経営学部 教授 吉田 靖
2015年8月	Vol.27No.08	JPX 国債先物ボラティリティ・インデックスの資産運用における利用可能性について	大阪取引所 市場企画部 飛田 昌宏 京都大学大学院 経営管理研究部 特定教授 加藤 康之
2015年7月	Vol.27No.07	日経 225 先物のボラティリティ予測について	創価大学 経済学部 教授 浅井 学
2015年6月	Vol.27No.06	新たな投資対象に育つか 配当指数先物	ニッセイ基礎研究所 チーフ株式ストラテジスト 井出 真吾

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2015年5月	Vol.27No.05	日経225先物市場における高速取引が現物市場の流動性に与える影響	長崎大学 経済学部 森保 洋
2015年4月	Vol.27No.04	情報の非対称性のリアルタイム計測としてのVPINを巡って	大阪大学・大学院経済学研究科 金融・保険教育研究センター 大屋 幸輔
2015年3月	Vol.27No.03	中国株価指数先物の日中ボラティリティ	対外経済貿易大学 西村 友作九州産業大学 船岡 健太
2015年2月	Vol.27No.02	日経平均VI先物と世界のボラティリティ取引	野村証券株式会社 金融工学研究センター クオンツ・リサーチ部 山中 智
2015年1月	Vol.27No.01	日経225先物と日経平均株価の収益率とボラティリティの関係について	創価大学 経済学部 教授 浅井 学
2014年12月	Vol.26No.12	海外投資家の「リスクオン・オフ」に反応する日経平均株価	大和総研 経済調査部 濱田 真也
2014年11月	Vol.26No.11	日経平均先物によるヘッジの会計	有限責任監査法人トーマツ 公認会計士 山口 毅
2014年10月	Vol.26No.10	リーマン・ショック後のデリバティブ取引規制 -OTC デリバティブの規制の在り方-	東京国際大学 教授 渡辺 信一
2014年9月	Vol.26No.09	分散リスク・プレミアム	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2014年8月	Vol.26No.08	実現測度データによるボラティリティ変動モデルの推定	甲南大学経済学部 石田 功
2014年7月	Vol.26No.07	取引所統合とわが国証券市場の展望	滋賀大学経済部 教授 二上 季代司
2014年6月	Vol.26No.06	現物株保有量を考慮した証券会社別日経225先物超過需要関数の導出	明海大学経済学部 准教授 新井 啓
2014年5月	Vol.26No.05	日経平均株価の長期トレンド分析	日本大学経済学部 准教授 三井 秀俊
2014年4月	Vol.26No.04	金先物市場における夜間立会時間延長の効果	神戸大学経済学研究科 岩壺 健太郎
2014年3月	Vol.26No.03	デリバティブ市場概説 展望編 -これからのデリバティブ市場-	大阪大学 名誉教授 仁科 一彦
2014年2月	Vol.26No.02	デリバティブ市場概説 歴史編 -デリバティブ市場を観察する-	大阪大学 名誉教授 仁科 一彦
2014年1月	Vol.26No.01	デリバティブ市場概説 機能編 -なぜデリバティブ市場が必要か-	大阪大学 名誉教授 仁科 一彦
2013年12月	Vol.25No.12	アントレプレナー・ファイナンスにおけるリアル・オプションの有用性	岐阜聖徳学園大学経済情報学部 准教授 高橋 陽二
2013年11月	Vol.25No.11	時間変動する相関と確率的ボラティリティモデル	大阪大学金融・保険教育研究センター 大阪証券取引所寄附研究部門 黒瀬 雄大
2013年10月	Vol.25No.10	デリバティブ市場の統合に寄せて	岡三証券株式会社 森本 敏喜

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2013年9月	Vol.25No.09	日経平均先物・オプション取引の銘柄拡充について	株式会社大阪証券取引所 市場企画部
2013年8月	Vol.25No.08	日経平均 VI 先物とその派生商品への投資	野村證券株式会社 金融工学研究センター クオンツ・リサーチ部 山中 智
2013年7月	Vol.25No.07	モデル・フリー・インプライド・ボラティリティの計算方法について	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2013年6月	Vol.25No.06	長期記憶モデルによる日経 225 先物のボラティリティに関する実証分析	日本大学経済学部 准教授 三井 秀俊
2013年5月	Vol.25No.05	店頭先物化 (Futurization of OTC)	滋賀大学経済学部 教授 二上 季代司
2013年4月	Vol.25No.04	2007 年度の日経平均先物市場の市場超過需要関数の計測	明海大学経済学部 准教授新井 啓
2013年3月	Vol.25No.03	調整局面・反発局面を含めた日経平均株価のトレンド識別	東洋大学経営学部 准教授 里吉 清隆 日本大学経済学部 准教授 三井 秀俊
2013年2月	Vol.25No.02	証券発行と銀行借入	専修大学経営学部 准教授 佐々木 浩二
2013年1月	Vol.25No.01	デリバティブ市場の使命と針路	大阪大学 名誉教授 仁科 一彦
2012年12月	Vol.24No.12	世界金融危機と金融工学—効率的市場仮説の蹉跌—	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2012年11月	Vol.24No.11	ボラティリティ・インデックス先物のプライシング	大阪大学 金融・保険教育研究センター 石田 功
2012年10月	Vol.24No.10	レバレッジ ETF・インバース ETF について	野村アセットマネジメント株式会社 商品企画部 田畑 邦一
2012年9月	Vol.24No.09	トレーディング環境の変化と運用アイデアについて	岡三証券株式会社 森本 敏喜
2012年8月	Vol.24No.08	連続時間確率的分散変動オプション価格の閉じた解の考察	日本大学経済学部 准教授 三井 秀俊
2012年7月	Vol.24No.07	日中データによる情報の非対称性の計測	大阪大学大学院経済学研究科 大屋 幸輔
2012年6月	Vol.24No.06	総合取引所の意義について考える	滋賀大学経済学部 教授 二上 季代司
2012年5月	Vol.24No.05	大阪証券取引所と CME グループの業務提携について —大証 NY ダウ先物取引の上場—	株式会社大阪証券取引所 デリバティブ企画グループ グループリーダー 塚本 浩敏
2012年4月	Vol.24No.04	デリバティブ市場への期待	明治学院大学 仁科 一彦
2012年3月	Vol.24No.03	証券会社別日経平均オプション超過需要関数の推定について	明海大学経済学部 准教授 新井 啓
2012年2月	Vol.24No.02	日経平均ボラティリティ・インデックスのリアルタイム算出について	日本経済新聞社 インデックス事業室 麻植 周
2012年1月	Vol.24No.01	金融レバレッジと市場経済	東京国際大学商学部 教授



発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
			渡辺 信一
2011年12月	Vol.23No.12	Financial Innovation	専修大学経営学部 准教授 佐々木 浩二
2011年11月	Vol.23No.11	日経平均株価のブル・ベア相場の分析 -マルコフ・スイッチング EGARCHモデルの応用-	東洋大学経営学部 准教授 里吉 清隆 日本大学経済学部 准教授 三井 秀俊
2011年10月	Vol.23No.10	ボラティリティ指数を利用した確率ボラティリティ・モデルの推定	大阪大学金融・保険教育研究センター 大阪証券取引所寄附研究部門 石田 功
2011年9月	Vol.23No.09	『株式先物市場のグローバル化について 再考』	岡三証券 森本 敏喜
2011年8月	Vol.23No.08	Realized GARCH モデル	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2011年7月	Vol.23No.07	個別証券会社の日経平均株価予想確率分布の推定	明海大学経済学部 准教授 新井 啓
2011年6月	Vol.23No.06	金融システムと「合成」ETF	滋賀大学経済学部 教授二上 季代司
2011年5月	Vol.23No.05	デリバティブ市場からのメッセージ	明治学院大学 仁科 一彦
2011年4月	Vol.23No.04	「J-GATE」導入後の変動局面を検証する	株式会社 フィスコ 取締役 リサーチ部門統括担当 伊藤 正雄
2011年3月	Vol.23No.03	マーコビッツ理論とスパゲッティアプローチ	横浜商科大学商学部 教授 可児 滋
2011年2月	Vol.23No.02	原資産価格のブル・ベアを考慮した日経 225 オプション価格の分析	東洋大学 経済学部 准教授 里吉 清隆 日本大学 経済学部 准教授 三井 秀俊
2011年1月	Vol.23No.01	「為替デリバティブが企業経営に及ぼすリスク」について考える	東京国際大学商学部 渡辺 信一
2010年12月	Vol.22No.12	Skewness と Kurtosis の観測と意義	SHERP Alternative Advisors Executive Director 堀内 剛
2010年11月	Vol.22No.11	Realized Volatility の変動のモデル化とオプション価格	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2010年10月	Vol.22No.10	J-GATE 稼働に伴う制度変更について(2)	株式会社 大阪証券取引所 市場企画グループ
2010年9月	Vol.22No.09	J-GATE 稼働に伴う制度変更について(1)	株式会社 大阪証券取引所 市場企画グループ
2010年8月	Vol.22No.08	KOSPI 先物の現場から見た日本の株式先物市場	ばんせい投信投資顧問株式会社 調査部長 廣重 勝彦
2010年7月	Vol.22No.07	個別証券会社の日経平均株価予想確率分布の期待値の推定とその変動	明海大学 経済学部 准教授 新井 啓
2010年6月	Vol.22No.06	日本版ボラティリティ・インデックス VXJ の時系列特性	大阪大学金融・保険教育研究センター 石田 功
2010年5月	Vol.22No.05	市場の透明性と流動性 -リーマン・ショックの教訓-	東京国際大学 商学部 教授 渡辺 信一

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2010年4月	Vol.22No.04	デリバティブ市場の新たな段階 —証券と商品の融合—	滋賀大学経済学部 ファイナンス学科 教授 二上 季代司
2010年3月	Vol.22No.03	日経 225 ディスパーション取引	野村證券 金融工学研究センター クオンツ・アナリスト 山中 智
2010年2月	Vol.22No.02	日経 225 の Realized Volatility -マイクロストラクチャ・ノイズと夜間・昼休みの調整-	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2010年1月	Vol.22No.01	2010年わが国デリバティブ市場の展望	大阪大学大学院 経済学研究科教授 仁科 一彦
2009年12月	Vol.21No.12	日経 225 先物の夜間取引について考える	株式会社 フィスコ 取締役 リサーチ部門統括担当 伊藤 正雄
2009年11月	Vol.21No.11	『株式先物市場の変化』(市場拡大について)	岡三証券株式会社 森本 敏喜
2009年10月	Vol.21No.10	日本版モデルフリー・ボラティリティ・インデックス	大阪大学大学院 経済学研究科 大屋 幸輔
2009年9月	Vol.21No.09	ETF と市場の流動性 -出来高増加のために必要なもの-	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2009年8月	Vol.21No.08	個別証券会社の日経平均株価予想値の推定	明海大学 経済学部 新井 啓
2009年7月	Vol.21No.07	FX のあらたな時代に向けて -レバレッジを考える-	ばんせい山丸証券株式会社 オンライン事業本部長廣重 勝彦
2009年6月	Vol.21No.06	日経 225 オプション市場の創設 20 周年に寄せて	大阪大学大学院経済学研究科 仁科 一彦
2009年5月	Vol.21No.05	日経 225 オプション市場開設 20 周年に寄せて	滋賀大学経済学部ファイナンス学科 教授 二上 季代司
2009年4月	Vol.21No.04	投資部門別取引状況の変遷	株式会社 フィスコ 取締役 リサーチ部門統括担当 伊藤 正雄
2009年3月	Vol.21No.03	Realized Volatility を用いた日経 225 オプション価格の導出	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2009年2月	Vol.21No.02	日経 225 先物と日経 225miniにおける価格発見	長崎大学経済学部 准教授 森保 洋
2009年1月	Vol.21No.01	金融危機とデリバティブ -取引所の役割-	横浜国立大学 大学院教授 浅野 幸弘
2008年12月	Vol.20No.12	証券化と情報の非対称性 -「金融工学」は、金融危機の真犯人か-	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2008年11月	Vol.20No.11	日経 225 先物取引の発展の中で -ディーリングが果たす役割-	ばんせい証券株式会社 トレーディング本部長 廣重 勝彦
2008年10月	Vol.20No.10	先物市場の流動性とミニ商品の導入 -CMM 法による 225 先物の流動性分析-	大阪国際大学 志馬 祥紀
2008年9月	Vol.20No.09	日経 225 先物上場 20 周年に寄せて ~展望と課題~	岡三証券 株式会社

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
			森本 敏喜
2008年8月	Vol.20No.08	日経 225 先物取引 20 周年によせて	大阪大学大学院 経済学研究科 教授 仁科 一彦
2008年7月	Vol.20No.07	「証券化」に潜むリスク	東洋大学 経済学部 非常勤講師 佐藤 正俊
2008年6月	Vol.20No.06	ラージとミニ先物の関係を検証する	株式会社 フィスコ 取締役 リサーチ部門統括担当 伊藤 正雄
2008年5月	Vol.20No.05	日経 225 先物市場における個別証券会社の経済行動の測定	明海大学経済学部 准教授 新井 啓
2008年4月	Vol.20No.04	サブプライム・ローンとデリバティブ	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2008年3月	Vol.20No.03	相場カタリストの流出 - 新たな投資機会の到来として -	丸三証券株式会社 廣重 勝彦
2008年2月	Vol.20No.02	ティック分析の展望～日経平均先物日中分析のカーブについて～	岡三証券株式会社 森本 敏喜
2008年1月	Vol.20No.01	2008年のわが国デリバティブ市場の展望	大阪大学大学院経済学研究科 教授 仁科 一彦
2007年12月	Vol.19No.12	モデル・フリー・インプライド・ボラティリティ	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明
2007年11月	Vol.19No.11	仕組み債のバリュー・アット・リスク算出について	東海東京証券株式会社 投資銀行営業推進部 研究開発グループ 山田 雅章、御手洗 孝子
2007年10月	Vol.19No.10	先物世界の構造変化	元近畿大学大学院 教授 高橋 弘
2007年9月	Vol.19No.09	デリバティブ取引の功罪	東京国際大学商学部 教授渡辺 信一
2007年8月	Vol.19No.08	世界の主要な株価指数先物と日経 225 先物を比較する	株式会社 フィスコ 統括執行役員 伊藤 正雄
2007年7月	Vol.19No.07	「日経 225mini」取引開始 1 周年を迎えて	株式会社大阪証券取引所 市場企画本部市場企画グループ グループリーダー 塚本 浩敏
		デリバティブに見る大証の革新性	横浜国立大学大学院 教授 浅野 幸弘
2007年6月	Vol.19No.06	先物取引開始 20 周年によせて - 個人投資家台頭の意義 -	(株)トレーダーズ・アンド・カンパニー 取締役 廣重 勝彦
		デリバティブ取引所の先導者として	大阪大学 理事・副学長 仁科 一彦
2007年5月	Vol.19No.05	金融デリバティブ市場の存在意義とその将来展望	滋賀大学経済学部ファイナンス学科 教授 二上 季代司
2007年4月	Vol.19No.04	アウトライヤー規制導入後の資金運用 ～中小金融機関の仕組み債リスク管理～	山田 雅章

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2007年3月	Vol.19No.03	Russell/Nomura Prime Index と TOPIX のリターン格差の要因分解	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 研究員 高尾 和弘
2007年2月	Vol.19No.02	日経 225mini の導入と個人投資家の行動特性 ー行動ファイナンスの視点からー	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2007年1月	Vol.19No.01	デリバティブと保険の臨界	多摩大学大学院 教授 宇佐美 洋
2006年12月	Vol.18No.12	日経 225 の“Realized Volatility”とインプライド・ボラティリティ	一橋大学経済研究所 教授 渡部 敏明 一橋大学大学院経済学研究科 博士課程 山口 圭子
2006年11月	Vol.18No.11	日経 225mini の創設意義 ー金融市場の本質から考えるー	南山大学経済学部 助教授 吉本 佳生
2006年10月	Vol.18No.10	マルコフ・スイッチング GARCH モデルを用いたオプション価格の分析(第2回)	東洋大学経営学部 助教授 里吉 清隆 日本大学経済学部 助教授 三井 秀俊
2006年9月	Vol.18No.09	マルコフ・スイッチング GARCH モデルを用いたオプション価格の分析(第1回)	東洋大学経営学部 助教授 里吉 清隆 日本大学経済学部 助教授 三井 秀俊
2006年8月	Vol.18No.08	閾値自己回帰モデルの日経平均株価指数への応用	山形大学人文学部 助教授 砂田 洋志
2006年7月	Vol.18No.07	市場参加者(トレーダー)から見た株式先物の変遷ー日経 225mini の真価ー	(株)トレーダーズ・アンド・カンパニー 取締役 廣重 勝彦
2006年6月	Vol.18No.06	天候デリバティブと証券デリバティブ	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2006年5月	Vol.18No.05	プット・オプション人気の分析	明海大学経済学部 講師 新井 啓
2006年4月	Vol.18No.04	自社株プットオプションの発行	香川大学経済学部 助教授 金 東吉
2006年3月	Vol.18No.03	アメリカでの個別株先物の離陸	(財)日本証券経済研究所 客員研究員 吉川 真裕
2006年2月	Vol.18No.02	オプション理論の観点から見たヘッジファンドの成功報酬	早稲田大学大学院ファイナンス研究科 教授四塚 利樹
2006年1月	Vol.18No.01	金融教育と投資サービス法と株価指数オプション取引	南山大学経済学部 助教授 吉本 佳生
2005年12月	Vol.17No.12	日本におけるデリバティブ取引の状況と海外投資家の動向	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2005年11月	Vol.17No.11	インプライド・ボラの株価予測性能を探る(2)～予想変動率は株価変動を予想するか?～	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 鈴木 清
2005年10月	Vol.17No.10	インプライド・ボラの株価予測性能を探る(1)～予想変動率は株価変動を予想するか?～	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 鈴木 清
2005年9月	Vol.17No.09	「指数先物市場ボラティリティ低下の一仮説」(NTトレードからのアプローチ)	岡三証券株式会社

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
			森本 敏喜
2005年8月	Vol.17No.08	日経 225 先物価格を用いた FIEGARCH モデルの推定	日本銀行金融研究所 シニアフェロー 渡部 敏明 リサーチアソシエイト 佐々木 浩二
2005年7月	Vol.17No.07	世界の株価指数先物・オプション	(財)日本証券経済研究所 客員研究員 吉川 真裕
2005年6月	Vol.17No.06	ヘッジ・ファンド規制と市場流動性	東京国際大学商学部 教授 渡辺 信一
2005年5月	Vol.17No.05	日経 225 先物価格の Realized Volatility	日本銀行金融研究所 シニアフェロー 渡部 敏明
2005年4月	Vol.17No.04	Russell/Nomura Prime インデックスの特徴～日経平均と比較して～	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 中嶋 啓浩
2005年3月	Vol.17No.03	年金運用において多様化する株価指数先物取引の利用	ラッセル・インベストメント・グループ シニア・コンサルタント 小原沢 則之
2005年2月	Vol.17No.02	『日経 225 オプション「ショート戦略」(2)～イントラデイ・データを用いたヘッジ・シミュレーション～	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 鈴木 清
2005年1月	Vol.17No.01	『日経 225 オプション「ショート戦略」(1)～イントラデイ・データを用いたヘッジ・シミュレーション～	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 鈴木 清
2004年12月	Vol.16No.12	東京都立大学 21 世紀 COE プログラム研究レポート(第 4 回)「Realized Volatility を用いた日経 225 先物価格のボラティリティの予測」	東京都立大学経済学部 教授 渡部 敏明 東京都立大学大学院社会科学部 博士課程 柴田 舞
2004年11月	Vol.16No.11	東京都立大学 21 世紀 COE プログラム研究レポート(第 3 回)「日経平均先物市場における Information-Based Trades」	日本銀行金融研究所 リサーチアソシエイト 佐々木 浩二
2004年10月	Vol.16No.10	東京都立大学 21 世紀 COE プログラム研究レポート(第 2 回)「日経平均先物ティックデータを用いた“order aggressiveness”の推定」	東京都立大学経済学部 COE 研究員 佐々木 浩二
2004年9月	Vol.16No.09	株式インデックスの発展と Russell/Nomura 日本株インデックス	野村証券金融経済研究所 金融工学研究センター 主任研究員 内山 朋規
2004年8月	Vol.16No.08	トレード技術とアノマリー予測	岡三証券株式会社 森本 敏喜
2004年7月	Vol.16No.07	東京都立大学 21 世紀 COE プログラム研究レポート(第 1 回)「日経 225 先物の価格および取引高の日中の変動パターン」	東京都立大学経済学部 教授 21 世紀 COE 拠点リーダー 渡部 敏明
2004年6月	Vol.16No.06	パワー・リバース・デュアル・カレンシー債の数理(2)～価格形成理論と非完備市場～	山田 雅章
2004年5月	Vol.16No.05	株価指数ボラティリティ先物	日本証券経済研究所 客員研究員 吉川 真裕
2004年4月	Vol.16No.04	日中変動分析がもたらす新たな知見	株式会社シーエムディーリサーチ 代表取締役副社長 尹 熙元
2004年3月	Vol.16No.03	パワー・リバース・デュアル・カレンシー債の数理(1)～商品の特徴とリスク～	柴田 百合子 山田 雅章
2004年2月	Vol.16No.02	アメリカのビジネススクールにおけるデリバティブ教育	滋賀大学経済学部 教授 小田野 純丸

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2004年1月	Vol.16No.01	オプション市場からみた原資産価格の予測可能性	モルガンスタンレー証券会社 株式調査部 神山 直樹 一橋大学大学院 博士後期課程 青木 岳人
2003年12月	Vol.15No.12	『効率的市場仮説』と『予測の必要性・活用』について	岡三証券株式会社 商品本部 森本 敏喜
2003年11月	Vol.15No.11	資産運用業の将来とデリバティブ	熊本経済大学経済学部 教授 渡辺 信一
2003年10月	Vol.15No.10	疑似乱数を利用したポートフォリオリスクにおける相関の検討	朝日ライフアセットマネジメント株式会社 西山 昇
2003年9月	Vol.15No.09	オプションアプローチによるリレーションシップバンキングの考察	山田 雅章
2003年8月	Vol.15No.08	オプション価格の評価とマルコフ連鎖モンテカルロ法	東京都立大学 経済学部 助教授 浅井 学
2003年7月	Vol.15No.07	インデックスリバランスにおける「良いインデックス」の条件	米国野村証券 グローバル・クオンツ・リサーチ 伊藤 桂一
2003年6月	Vol.15No.06	2変量モデルによるヘッジの効率性	東京都立大学経済学部 教授 渡部 敏明 東京都立大学大学院社会科学部 博士課程 柴田 舞
2003年5月	Vol.15No.05	アメリカでの個別株先物取引	吉川 真裕
2003年4月	Vol.15No.04	目で見える株価指数先物取引市場(3) ～ マクロ基礎データからマイクロ・ストラクチャーまで ～	野村証券金融研究所 投資技術研究部 鈴木 清
2003年3月	Vol.15No.03	目で見える株価指数先物取引市場(2) ～ マクロ基礎データからマイクロ・ストラクチャーまで ～	野村証券金融研究所 投資技術研究部 鈴木 清
2003年2月	Vol.15No.02	目で見える株価指数先物取引市場(1) ～ マクロ基礎データからマイクロ・ストラクチャーまで ～	野村証券金融研究所 投資技術研究部 鈴木 清
2003年1月	Vol.15No.01	ARCH型モデルを用いた日経225オプション価格の計量分析	東京都立大学経済学部 教授 渡部 敏明
2002年12月	Vol.14No.12	ポートフォリオ理論を応用したインデックスボラティリティの検討	朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 西山 昇
2002年11月	Vol.14No.11	理論価格を下回り売込まれる株価指数先物	野村証券金融研究所 投資技術研究部 鈴木 清
2002年10月	Vol.14No.10	電力自由化におけるリアルオプション分析	UFJつばさ証券 山田 雅章
2002年9月	Vol.14No.09	ETF市場と先物取引 -ティック・データによる分析	熊本学園大学経済学部 教授 渡辺 信一
2002年8月	Vol.14No.08	日中気配データを用いたプット・コール・パリティの検証	青山学院大学経済学部 助教授 芹田 敏夫
2002年7月	Vol.14No.07	求められる「先物悪玉論」的思考からの脱却	野村総合研究所 資本市場研究室長(大証コンプライアンス・コミッティ委員) 大崎 貞和
2002年6月	Vol.14No.06	インデックス運用の功罪	熊本学園大学経済学部 助教授 渡辺 信一
2002年5月	Vol.14No.05	ETFと株価指数先物	吉川 真裕

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2002年4月	Vol.14No.04	外国株式運用の新潮流 ～求められる「マルチナショナル投資」～	野村証券投資技術研究部 伊藤 桂一
2002年3月	Vol.14No.03	FTSE 日本 (FTSE Japan) 指数について	野村証券投資技術研究部 伊藤 桂一
2002年2月	Vol.14No.02	MSCI 及び MSCI 指数について	モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル 東京支店
2002年1月	Vol.14No.01	Nasdaq-100 先物取引制度の創設について	大阪証券取引所 経営企画本部 企画グループ
2001年12月	Vol.13No.12	ダウ・ジョーンズ工業株平均 先物取引制度の創設について	大阪証券取引所 経営企画本部 企画グループ
2001年11月	Vol.13No.11	緊急時の制限値幅の扱いについて ～米国同時テロと日本株式市場への影響～	野村証券金融研究所 デリバティブスリサーチグループ 主任研究員 大庭 昭彦
2001年10月	Vol.13No.10	ベンチマークの新しい必要条件 ～浮動株修正とその周辺～	野村証券金融研究所 デリバティブスリサーチグループ 主任研究員 大庭 昭彦
2001年9月	Vol.13No.09	米国におけるクレジット・デリバティブ課税	(株)日本総合研究所 副主任研究員 神戸大学経営学修士/(社)証券アナリスト協会検定会員 柏崎 秀幸
2001年8月	Vol.13No.08	ダウ平均と日経 225: その類似点と相違点	ダウ・ジョーンズ・インデクシーズ社 シェルドン・ガオ博士との対談
2001年7月	Vol.13No.07	個人投資家と株式オプション	(株)野村総合研究所 資本市場研究部 岩谷 賢伸
2001年6月	Vol.13No.06	企業の規模特性とヘッジ会計の選択行動	神戸大学 教授 古賀 智敏
2001年5月	Vol.13No.05	アメリカにおけるデリバティブ課税 -2-	神戸大学 教授 古賀 智敏
2001年4月	Vol.13No.04	アメリカにおけるデリバティブ課税 -1-	神戸大学 教授 古賀 智敏
2001年3月	Vol.13No.03	個別株先物の将来性	(株)日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 吉川 真裕
2001年2月	Vol.13No.02	クレジット・デリバティブの公正価値会計 -2-	神戸大学 教授 古賀 智敏
2001年1月	Vol.13No.01	クレジット・デリバティブの公正価値会計 -1-	神戸大学 教授 古賀 智敏
2000年12月	Vol.12No.12	他社株転換可能債 (EB) 市場の概観	大和総研 投資調査部 壁谷 洋和
2000年11月	Vol.12No.11	ダウ・ジョーンズ工業株平均及びナスダック 100 の概要	大阪証券取引所 T. N
2000年10月	Vol.12No.10	日経平均株価指数構成銘柄入替を巡る問題について -2-	大阪証券取引所 Y. S.
2000年9月	Vol.12No.09	日経平均株価指数構成銘柄入替を巡る問題について -1-	大阪大阪証券取引所 Y. S.
2000年8月	Vol.12No.08	オプション取引データに基づいた状態価格密度の推計について: 大阪証券取引所の事例 -2-	大阪大学大学院経済学研究科 助教授 齊藤 誠 大阪府立大学経済学部 講師 高木 真吾

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
2000年7月	Vol.12No.07	オプション取引データに基づいた状態価格密度の推計について:大阪証券取引所の事例 -1-	大阪大学大学院経済学研究科 助教授 齊藤 誠 大阪府立大学経済学部 講師 高木 真吾
2000年5月	Vol.12No.05	日経平均採用銘柄選定基準の変更について	新光証券株式会社 企業調査部新藤 龍秋
2000年4月	Vol.12No.04	アメリカに生まれた新たな有力商品:Eミニ S&P 500 株価指数先物	(財)日本証券経済研究所 大阪研究所 主任研究員 吉川 真裕
2000年3月	Vol.12No.03	デリバティブを使った個人資産ヘッジ	ウェストエルビー証券会社 株式派生商品部 T. O
2000年2月	Vol.12No.02	SPAN®採用に伴う先物・オプション取引に係る証拠金制度の改正について	大阪証券取引所
2000年1月	Vol.12No.01	流動性を考慮したインデックスの試算	日興リサーチセンター 投資工学研究所 喜多 洋一
1999年12月	Vol.11No.12	CMEにおける日経225先物取引の価格形成	大阪証券取引所 職員
1999年11月	Vol.11No.11	SPAN®(スパン)の採用について-3-	大阪証券取引所 総合企画部 企画課 樋出 幹雄
1999年10月	Vol.11No.10	SPAN®(スパン)の採用について-2-	大阪証券取引所 総合企画部 企画課 樋出 幹雄
1999年9月	Vol.11No.09	SPAN®(スパン)の採用について-1-	大阪証券取引所 総合企画部 企画課 樋出 幹雄
		資産運用におけるデリバティブ-5- ~米国年金スポンサーのデリバティブ利用~	野村証券金融研究所 投資技術研究部 年金運用研究グループ 副主任研究員 荻島 誠治
1999年8月	Vol.11No.08	資産運用におけるデリバティブ-4- ~株式ポートフォリオのヘッジについて~	野村証券金融研究所 主任研究員 中嶋 啓浩
1999年7月	Vol.11No.07	転換社債のリスク管理	興銀第一フィナンシャルテクノロジー株式会社 山本 毅、白石 愛
		資産運用におけるデリバティブ-3- ~デリバティブ投資の管理方法~	年金資金運用研究センター 研究員 西迫 伸一
1999年6月	Vol.11No.06	資産運用におけるデリバティブ-2- ~損失の発生過程とその対処方法~	年金資金運用研究センター 研究員 西迫 伸一
1999年5月	Vol.11No.05	海外のカバードワラント市場について	クレディ・リヨネ証券会社 東京支店 エクイティ・デリバティブ部
		資産運用におけるデリバティブ-1- ~年金運用における株式オプションの利用~	年金資金運用研究センター 研究員 西迫 伸一
1999年4月	Vol.11No.04	デリバティブ取引の会計の動向(3) -オプション取引の会計処理に関する実態分析-	甲南大学教授 河崎 照行
1999年3月	Vol.11No.03	ヨーロッパの株式デリバティブ市場	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 吉川 真裕
		デリバティブ取引の会計の動向(2) -先物取引の利用実態と会計の動向-	近畿大学助教授 浦崎 直浩
1999年2月	Vol.11No.02	最近のヘッジファンドの動向について-2-	さくら証券株式会社 松村 尚彦



発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		デリバティブ取引の会計の動向(1) -アメリカ FASB の展開を中心として-	神戸大学教授 古賀 智敏
1999 年 1 月	Vol.11No.01	最近のヘッジファンドの動向について-1-	さくら証券株式会社 松村 尚彦
		証券先物取引等に係る証拠金の改正法令・規則について	大阪証券取引所 職員
1998 年 12 月	Vol.10No.12	OTC デリバティブ解禁と上場先物・オプションへの影響	大阪証券取引所 職員
		有価証券デリバティブ取引に係る改正証券取引法の規定について	大阪証券取引所 職員
1998 年 11 月	Vol.10No.11	1997 年の世界のオプション取引所市場(その 2)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブのリスク管理について-6- ~デリバティブの会計~	大和証券株式会社 金融商品開発部 業務企画課 稲田 雄一郎
1998 年 10 月	Vol.10No.10	1997 年の世界のオプション取引所市場(その 1)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブのリスク管理について-5- ~リーガル・リスクと契約書~	大和証券株式会社 金融商品開発部 渡辺 芳則、和田 正巳
1998 年 9 月	Vol.10No.09	デリバティブのリスク管理について-5- ~デリバティブのシステム開発~	大和証券株式会社 金融商品開発部 川島 典夫
1998 年 8 月	Vol.10No.08	先物・オプション取引における証拠金及び値洗い制度の改正要綱について	大阪証券取引所 職員
		デリバティブのリスク管理について-4- ~市場リスク指標と VAR~	大和証券株式会社 金融商品開発部 稲田 雄一郎
1998 年 7 月	Vol.10No.07	過去の SQ の動き	ジャーディン・フレンジ証券会社 先物・オプション部 ジョン・ヤン
		デリバティブのリスク管理について-3- ~信用リスクの管理~	大和証券株式会社 金融商品開発部 西谷 精洋、和田 正巳
1998 年 6 月	Vol.10No.06	業種別株価指数の特性について-日経 225 株価指数との比較を中心に-	大阪証券取引所 職員
		デリバティブのリスク管理について-2- ~リスク管理体制の構築(2)~	大和証券株式会社 金融商品開発部 村越 正明
1998 年 5 月	Vol.10No.05	業種別株価指数先物・オプション取引の導入について	大阪証券取引所 職員
		デリバティブのリスク管理について-1- ~リスク管理体制の構築(1)~	大和証券株式会社 金融商品開発部 村越 正明
1998 年 4 月	Vol.10No.04	大証の業種別株価指数先物:基本分析と利用方法	ゴールドマン・サックス証券会社 エクイティ・デリバティブ・リサーチ バイス・プレジデント クリストファー・オーヤン
		店頭エクイティ・デリバティブについて(4)	日興証券株式会社 投資工学研究所
1998 年 3 月	Vol.10No.03	業種別株価指数先物・オプション取引の導入について	大阪証券取引所 職員
		店頭エクイティ・デリバティブについて(3)	日興証券株式会社 投資工学研究所
1998 年 2 月	Vol.10No.02	平成 9 年の先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
		店頭エクイティ・デリバティブについて(2)	日興証券株式会社 投資工学研究所
1998 年 1 月	Vol.10No.01	米国における業種別株価指数オプションについて	モルガン・スタンレー証券会社 東京支店 株式先物オプション部 ショーン・バードン
		店頭エクイティ・デリバティブについて(1)	日興証券株式会社 投資工学研究所

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
1997年12月	Vol.09No.12	世界の先物・オプション取引所の最近の動向	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 所長 中村 稔
1997年11月	Vol.09No.11	「先物・オプション取引に係る証拠金及び値洗い制度の改正」における委託証拠金制度について	大阪証券取引所
1997年10月	Vol.09No.10	ソニー・オプションの流動性の比較	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 吉川 真裕
		個別株オプションの実際～OTC市場の現場から～(第4回 最終回)	T.O.
1997年9月	Vol.09No.09	株券オプションの取引状況について	大阪証券取引所 職員
		個別株オプションの実際～OTC市場の現場から～(第3回)	T.O.
1997年8月	Vol.09No.08	株券オプションの取引状況	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 吉川 真裕
		個別株オプションの実際～OTC市場の現場から～(第2回)	T.O.
1997年7月	Vol.09No.07	個別株オプションにおけるヘッジ～カバード・コールとプロテクティブ・プット	ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店 日本株式営業部 株券オプションデスク クディビッド・ベーカー、清水 洋介
		株券オプション開始にあたって	勸角証券株式会社 エクイティ・トレーディング部 木ノ内 浩敏
		個別株オプションの実際～OTC市場の現場から～(第1回)	T.O.
1997年6月	Vol.09No.06	個別株オプションについて	日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 二上 季代司
		株券オプションへの期待	野村証券株式会社 金融研究所 投資技術研究部 西迫 伸一
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(6 最終回)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1997年5月	Vol.09No.05	株券オプション取引の仕組み	大阪証券取引所 職員
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(5)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1997年4月	Vol.09No.04	個別株オプションの利用法(2)	山一証券株式会社 投資情報部 増田 広
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(4)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1997年3月	Vol.09No.03	個別株オプションの利用法(1)	山一証券株式会社 投資情報部 増田 広
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(3)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1997年2月	Vol.09No.02	平成8年の日経300及び日経225先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(2)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1997年1月	Vol.09No.01	デリバティブ・ヘッジ会計の動向(2)	立命館大学経営学部 専任講師 澤邊 紀生
		パソコンで学ぶ株価指数先物・オプション講座(1)	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム プログラム・アナリスト 嶋澤 宗一
1996年12月	Vol.08No.12	デリバティブ・ヘッジ会計の動向(1)	立命館大学経営学部 専任講師 澤邊 紀生
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(20 最終回) 第十章 講座を振り返って	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム ストラテジスト 城下 関応
1996年11月	Vol.08No.11	米国の個別株オプションのボラティリティー ～株価指数オプションとの比較～	大和証券株式会社 株式先物オプション部 中谷 裕毅
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(19) 第九章 株価指数先物・オプションの理解に役立つ諸知識 その2 先物取引に関わるテクニカル手法の数々…後編	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム ストラテジスト 城下 関応
1996年10月	Vol.08No.10	インプライド・ボラティリティーの推移について	新日本証券株式会社 投資情報部 永吉 悟
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(18) 第九章 株価指数先物・オプションの理解に役立つ諸知識 その2 先物取引に関わるテクニカル手法の数々…前編	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム ストラテジスト 城下 関応
1996年9月	Vol.08No.09	ストライク・プライス、限月によるボラティリティー・カーブを考える	ソロモン・ブラザーズ・アジア証券会社 東京支店 投資戦略調査部 ブレット・イングルカマイヤー
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(17) 第九章 株価指数先物・オプションの理解に役立つ諸知識 その1 先物・オプションの理解を深めるために役立つ数学	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・トレーディングチーム ストラテジスト 城下 関応
1996年8月	Vol.08No.08	先物市場規制の影響(更新値幅・更新時間を中心に)	日興証券株式会社 運用開発部 デリバティブトレーディング一課 課長代理 樋口 勝彦
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(16) 第七章 株価指数先物・オプションを利用したヘッジ 3 株価指数オプションを利用したヘッジ 第八章 ポートフォリオ・インシュランス	日本債券信用銀行 キャピタル・マーケット第4グループ エクイティ・デリバティブチーム シニア・トレーダー 城下 関応
1996年7月	Vol.08No.07	日経平均株価とTOPIXのリターンの乖離と市場環境	モルガン・スタンレー証券会社 東京支店 株式部 クオンツ・リサーチ・グループ 高橋 文行
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(15) 第七章 株価指数先物・オプションを利用したヘッジ 1 ヘッジとは、2 株価指数先物を利用したヘッジ	ドイチェ・モルガン・グレンフェル証券会社 東京支店 トレーディング部 クオンツ・トレーダー 城下 関応
1996年6月	Vol.08No.06	取引所で行うデリバティブ取引のディスクロージャーについて	大阪証券取引所 職員

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(14) 第六章 株価指数先物・オプションを用いた裁定取引 その2 裁定取引の実際	ドイチェ・モルガン・グレンフェル証券会社 東京支店 トレーディング部 クォンツ・トレーダー 城下 関応
1996年5月	Vol.08No.05	日経300限月間スプレッド取引の導入について 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(13) 第六章 株価指数先物・オプションを用いた裁定取引 その1	大阪証券取引所 職員 ドイチェ・モルガン・グレンフェル証券会社 東京支店 トレーディング部 クォンツ・トレーダー 城下 関応
1996年4月	Vol.08No.04	限月間スプレッド取引開始に当たり 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(12) 第四章 限月間スプレッド取引の実際 日経300先物の限月間スプレッド取引の誕生 第五章 デリバティブ取引規制論議の推移	ゴールドマン・サックス証券会社 エクイティ・デリバティブ・リサーチ クリストファー・オーヤン ドイツ銀証券会社 東京支店 トレーディング部 クォンツ・トレーダー 城下 関応
1996年3月	Vol.08No.03	NT ベーシス取引のリスク計測 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(11) 第三章 株価指数オプション 応用編その2 オプション・ポジションの管理	大和総研 投資調査部 研究員 上田 祐介 ドイツ銀証券会社 東京支店 トレーディング部 クォンツ・トレーダー 城下 関応
1996年2月	Vol.08No.02	平成7年の日経300及び日経225先物・オプション市場について 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(10) 第三章 株価指数オプション 応用編その1 オプションを用いた戦略	大阪証券取引所 職員 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1996年1月	Vol.08No.01	アフターアワー・オプション 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(9) 第三章 株価指数オプション 1 基礎編その3 ブラック・ショールズモデル	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年12月	Vol.07No.12	欧州エクイティ・デリバティブ事情(3・完) 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(8) 第三章 株価指数オプション 1 基礎編その2	日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 二上 季代司 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年11月	Vol.07No.11	欧州エクイティ・デリバティブ事情(2) 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(7) 第三章 株価指数オプション 1 基礎編その1…その概要	日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 二上 季代司 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年10月	Vol.07No.10	欧州エクイティ・デリバティブ事情(1) 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(6) 第二章 株価指数先物取引 2 応用編その2	日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 二上 季代司 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年9月	Vol.07No.09	我が国における株価指数先物・オプション取引の開始と現物市場の効率性 一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(5) 第二章 株価指数先物 2 応用編その1	東京都立大学経済学部 助教授 渡部 敏明 ドイツ銀証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
1995年8月	Vol.07No.08	日経300指数連動型上場投資信託と日経300指数	野村證券株式会社 エクイティ部 業務開発課長 綱川 敏彦
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(4) 第二章 株価指数先物 1 基礎編—先物取引の基本的な考え方とその仕組み	ドイツ証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年7月	Vol.07No.07	1993年デリバティブ調査(3・完)	大阪証券取引所 職員
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(3) 第一章 日本における株 価指数先物・オプション市場の歴史とその背景(続編) ステージ3 日経300先物・ オプションの誕生	ドイツ証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年6月	Vol.07No.06	現物市場と先物市場:国際比較	(財)日本証券経済研究所 吉川 真裕
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(2) 第一章 日本における株 価指数先物・オプション市場の歴史とその背景(続編) ステージ2 日経225先物・ オプションの誕生	ドイツ証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年5月	Vol.07No.05	1993年デリバティブ調査(2)	大阪証券取引所 職員
		一般投資家のための株価指数先物・オプション講座(1) 第一章 日本の株価指数 先物・オプション市場の歴史とその背景 ステージ1 株先50上場	ドイツ証券会社 東京支店 派生商品営業部 課長 城下 関応
1995年4月	Vol.07No.04	オーストラリア先物・オプション市場管見	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄
		世界の先物・オプション市場(6 最終回) 香港先物・オプション市場	モルガン・スタンレー・アジア エクイティ・デリバティブ エドワード・リュウ
1995年3月	Vol.07No.03	1993年デリバティブ調査(1)	大阪証券取引所 職員
1995年2月	Vol.07No.02	平成6年の日経300及び日経225先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
		世界の先物・オプション市場(5) ドイツの先物・オプション市場	ドイツ証券会社 東京支店 副支店長兼トレーディング本部長 フィリップ・アブリル
1995年1月	Vol.07No.01	株価変動とリスクマネジメント	野村證券投資信託委託(株) 株式トレーディング室 次長 丸山 和彦
		世界の先物・オプション市場(4) スイス株価指数先物・オプション	スイスバンクコーポレーション チューリッヒ 国際金融部 株式関連CM&Tリサ ーチ アレクサンダー・M・イナイヘン
1994年12月	Vol.06No.12	日本の株価指数オプションのインプライド・ボラティリティ:行使価格や期間との関係	ゴールドマン・サックス・アンド・カンパニー エクイティ・デリバティブズ・リサー チ 部 パートナー マーク・A・ズーラック 東京支店 クリス・オーヤン
		世界の先物・オプション市場(3) フランスの先物・オプション市場について	ソシエテ ジェネラル証券会社 東京支店 先物・オプション営業部 部長 エティエンヌ・デニオ
1994年11月	Vol.06No.11	日経300先物・オプション取引の現状について	大阪証券取引所 職員
		世界の先物・オプション市場(2) 英国LIFFEの指数先物とオプション	エス・ジー・ウォーバーク証券 ロンドン 派生商品調査部 シヨン・オシェ
1994年10月	Vol.06No.10	CBOEの日経300オプションとオーストラリアの「シェア・レシオ」	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 主任研究員 中村 稔

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		世界の先物・オプション市場(1) 米国における株式派生商品の変遷	ゴールドマン・サックス・アンド・カンパニー エクイティ・デリバティブズ・リサーチ部 ジョアン・ヒル, PhD
1994年9月	Vol.06No.09	デリバティブ規制論議とその行方	キダー・ピーボディ証券 株式部長 田中 良治
		年金資金運用と派生商品-5(最終回)- 年金制度の目的と金融派生商品の役割	広島大学経済学部 助教授 越智 泰樹
1994年8月	Vol.06No.08	ボラティリティと株価変動～IV 変動から原資産のリスクプレミアムを推定する～	大和総研 投資調査部 櫻岡 崇
1994年7月	Vol.06No.07	1分刻みデータから見た先物市場	(財)日本証券経済研究所大阪研究所 吉川 真裕
		年金資金運用と派生商品-4- 運用企画担当者から	大阪証券取引所 職員
1994年6月	Vol.06No.06	先物取引高と現物価格のボラティリティー	東京都立大学経済学部 助教授 渡部 敏明
		年金資金運用と派生商品-3- 年金資金の運用とデリバティブ	大阪証券取引所 職員
1994年5月	Vol.06No.05	先物市場の現状と展望	(株)山一証券経済研究所 澤田 英之
		年金資金運用と派生商品-2- 米国年金の新先物戦略	大阪証券取引所 職員
1994年4月	Vol.06No.04	日経300先物取引開始直後の5週間	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄
		年金資金運用と派生商品-1- 米国年金基金の運用実態について	大阪証券取引所 職員
1994年3月	Vol.06No.03	日経300先物・オプションの取引状況等について	大阪証券取引所 職員
1994年2月	Vol.06No.02	平成5年の日経225先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
1994年1月	Vol.06No.01	新指数「日経300」の基本構造	法政大学 教授 大村 敬一
		日経300先物・オプション取引開始を迎えるにあたって	大和証券株式会社 株式先物オプション部 課長 坂元 暢
1993年12月	Vol.05No.12	新指数日経300の特長	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄
		デリバティブ実践講座-12- 上級編 ユーザーが派生商品を使うことの意味	大阪証券取引所 職員
1993年11月	Vol.05No.11	日経300新指数について	日興証券株式会社 運用開発部 副部長 藤山 健三
		日経300と機関投資家	日本生命保険相互会社 株式部長 簗島 則和
		先物取引の指数の条件	野村証券株式会社 株式開発室投資モデル開発課長 綱川 敏彦
		日経株価指数300の特徴と期待される役割	(株)富士総合研究所 特別研究グループ 研究員 和田 良子
		デリバティブ実践講座-11- 上級編 OTC市場の実際(6) エクイティ・スワップ	大阪証券取引所 職員

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
1993年10月	Vol.05No.10	先物市場規制の目的	エラスムス大学 O. W. ステンベーク
		世界の金融先物・オプション取引所(9・完) スイス・オプション金融先物取引所(SOFFEX)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-10- 上級編 OTC市場の実際(5) 複数資産に関わるエキゾチック・オプションズ	大阪証券取引所 職員
1993年9月	Vol.05No.09	世界の金融先物・オプション取引所(8) ドイツ先物オプション取引所(DTB)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-9- 上級編 OTC市場の実際(4) エキゾチック・オプションズ(続)	大阪証券取引所 職員
1993年8月	Vol.05No.08	日経平均先物市場における取引プロセスと価格形成	甲南大学経済学部 助教授 芹田 敏夫
		世界の金融先物・オプション取引所(7) パリ金融先物取引所(MATIF)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-8- 上級編 OTC市場の実際(3) エキゾチック・オプションズ	大阪証券取引所 職員
1993年7月	Vol.05No.07	世界の金融先物・オプション取引所(6) ヨーロピアン・オプション取引所(EOE)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-7- 上級編 OTC市場の実際(2) OTCオプション市場の特徴	大阪証券取引所 職員
1993年6月	Vol.05No.06	シカゴでの思い出	コスモ証券株式会社 金融法人部 係長 保科 正則
		世界の金融先物・オプション取引所(5) ロンドン国際金融先物取引所(LIFFE)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-6- 上級編 少し変わったセルボラ スペアリブ	大阪証券取引所 職員
1993年5月	Vol.05No.05	欧米における株式派生商品 OTC市場について	日興証券株式会社 運用開発部 副部長 忍田 登南
		先物市場の最近の動向について	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-5- 上級編 世界の中の日経225先物・オプション	大阪証券取引所 職員
1993年4月	Vol.05No.04	世界の株価指標	大阪証券取引所 職員
		世界の金融先物・オプション取引所(4) シカゴ・ボード・オブ・トレード(CBOT)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-4- 上級編 OTC市場の実際(1) OTCオプション市場と株価リンク債	大阪証券取引所 職員
1993年3月	Vol.05No.03	「日経225先物市場の今後について」の趣旨説明のための企業訪問から	大阪証券取引所 職員
		世界の金融先物・オプション取引所(3) シカゴ・ボード・オブ・オプション取引所(CBOE)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-3- 上級編 ポートフォリオヘッジオペレーション	大阪証券取引所 職員
1993年2月	Vol.05No.02	「脆弱な先物指数が株暴落の一因だった」に反論する	大阪証券取引所 調査部主査 野添 隆治
		平成4年の日経225先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
		世界の金融先物・オプション取引所(2) シカゴ・マーカンタイル取引所(CME)	大阪証券取引所 職員
		デリバティブ実践講座-2- 上級編 日経225オプションセータ戦略	大阪証券取引所 職員
1993年1月	Vol.05No.01	日経225先物市場の今後について	大阪証券取引所
		デリバティブ実践講座-1- 上級編 日経225先物・オプションアウトライク	大阪証券取引所 職員
1992年12月	Vol.04No.12	世界の金融先物・オプション取引所(1) シンガポール国際金融取引所(SIMEX)	大阪証券取引所 職員

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		先物実践講座-12- 日経 225 先物戦略 92 年日経 225 先物市場をふりかえって	ポジション・トレーダー、ファンド・マネジャー、セールス・トレーダー、金法担当者、機関投資家、法人担当者、自己ポジション担当者、調査担当者
1992 年 11 月	Vol.04No.11	日経 225 先物市場の最近の状況について	大阪証券取引所 職員
		世界の株価指数先物市場をめぐる最近の動き	(財)日本証券経済研究所 研究員 吉川 真裕
		先物実践講座-11- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践⑧ 裁定取引の現状	大阪証券取引所 職員
1992 年 10 月	Vol.04No.10	日経平均株価構成銘柄の入替え前後の動向	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-10- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践⑦ その他の裁定取引	大阪証券取引所 職員
1992 年 9 月	Vol.04No.09	日経 225 先物市場における最近の取引状況について	大阪証券取引所 職員
		サーキット・ブレーカーについて(2・完)	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-9- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践⑥ 限月間スプレッド取引	大阪証券取引所 職員
1992 年 8 月	Vol.04No.08	サーキット・ブレーカーについて(1)	大阪証券取引所 職員
		日経 225 オプションの取引状況について-ヨーロッパ・タイプへの変更を中心に-	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-8- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践⑤ ポートフォリオ・インシュアランス	大阪証券取引所 職員
1992 年 7 月	Vol.04No.07	インプライド・ボラティリティの予測効率性	甲南大学経済学部 専任講師 芹田敏夫
		先物実践講座-7- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践④ インターマーケットアービトラージ取引	大阪証券取引所 職員
1992 年 6 月	Vol.04No.06	先物市場における最近の変化について	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-6- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践③ テクニカル的アプローチ(続)	大阪証券取引所 職員
1992 年 5 月	Vol.04No.05	先物取引規制とその影響	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-5- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践② テクニカル的アプローチ(続)	大阪証券取引所 職員
1992 年 4 月	Vol.04No.04	機関投資家との懇談から	大阪証券取引所 職員
		日経 225 オプションと S&P100 オプション(3)-データからみた両オプションの比較-	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-4- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の実践① テクニカル的アプローチ	大阪証券取引所 職員
1992 年 3 月	Vol.04No.03	疑わしきは罰せず 日本の先物取引をめぐる最近の議論と小手先の規制に関するコメント	一橋大学経済研究所 ドイツ・マールブルグ大学日本研究センター 助教授 ウルリケ・シェーデ
		日経 225 オプションと S&P100 オプション(2)-データからみた両オプションの比較-	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-3- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の基礎③ 裁定取引	大阪証券取引所 職員
1992 年 2 月	Vol.04No.02	平成 3 年の先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
		日経 225 先物及びオプションの米国での取引	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-2- 日経 225 先物戦略 先物投資戦略の基礎② ヘッジ取引	大阪証券取引所 職員



発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
1992年1月	Vol.04No.01	日経225オプションとS&P100オプション(1)-データからみた両オプションの比較-	大阪証券取引所 職員
		先物実践講座-1- 日経225先物戦略 先物投資戦略の基礎① オープン・ポジション取引	大阪証券取引所 職員
1991年12月	Vol.03No.12	CBOEの新商品キャップスについて	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-25最終回- 日経225オプション戦略 派生商品市場と現物市場	大阪証券取引所 職員
1991年11月	Vol.03No.11	日経平均株価構成銘柄の入替えについて	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-24- 日経225オプション戦略 リスク管理その2	大阪証券取引所 職員
1991年10月	Vol.03No.10	先物取引と信用取引	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-23- 日経225オプション戦略 リスク管理その1	大阪証券取引所 職員
1991年9月	Vol.03No.09	値洗い差金からみた日経225先物市場	大阪証券取引所 職員
		-座談会-オプション取引の魅力を語る-実践経験から	個人投資家、機関投資家、先物・オプショントレーダー、準大手証券先物・オプション取引責任者
		オプション実践講座-22- 日経225オプション戦略 基本戦略の応用	大阪証券取引所 職員
1991年8月	Vol.03No.08	機関投資家との懇談を終えて	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-21- 日経225オプション戦略 アクティブ・インデックス運用	大阪証券取引所 職員
1991年7月	Vol.03No.07	銀行、証券等の先物・オプション取引に係る時価情報について	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-20- 日経225オプション戦略 ヘッジその2	大阪証券取引所 職員
1991年6月	Vol.03No.06	-座談会-先物・オプション市場の現状と問題点	日興証券 トレーディング開発部第一開発課長 忍田 登南 日本経済新聞社 証券部記者 木村 貴 山一証券 株式先物オプション部長 馬弓 克夫 司会:大阪証券取引所 調査部長 中村 稔
		オプション実践講座-19- 日経225オプション戦略 ヘッジその1	大阪証券取引所 職員
1991年5月	Vol.03No.05	先物・オプションと株式市場機能	(財)日本証券経済研究所 主任研究員 紺谷 典子
		オプション実践講座-18- 日経225オプション戦略 ボラティリティ・プレー	大阪証券取引所 職員
1991年4月	Vol.03No.04	日経225先物の裁定機会はザラバで調整されているか	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄
		先物市場をめぐる諸問題	丸三証券株式会社 会長 金子 太郎
		オプション実践講座-17- 日経225オプション戦略	大阪証券取引所 職員
1991年3月	Vol.03No.03	株価暴落を奇貨に個人投資家拡大へ本腰を	東洋経済新報社 第一編集局 企業情報部 副部長 今井 念雄
		オプション実践講座-16- 日経225オプション戦略 合成先物・オプションその4 合成オプション	大阪証券取引所 職員
1991年2月	Vol.03No.02	平成2年の先物・オプション市場について	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-15- 日経225オプション戦略 合成先物・オプションその3 裁定取引-2-	大阪証券取引所 職員
1991年1月	Vol.03No.01	グローバル化する日本株式の派生商品取引	ゴールドマン・サックス証券会社 東京支店 GEDP 部長 小橋 慶和

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		オプション実践講座-14- 日経 225 オプション戦略 合成先物・オプションその 2 裁定取引-1-	大阪証券取引所 職員
1990 年 12 月	Vol.02No.12	日経 225 オプションの最近の動きについて オプション実践講座-13- 日経 225 オプション戦略 合成先物・オプションその 1 合成先物とウィンドー	大阪証券取引所 職員 大阪証券取引所 職員
1990 年 11 月	Vol.02No.11	気配更新の変更措置と先物価格-先行性から遅行性へ- トレーダーの意見 オプション実践講座-12- 日経 225 オプション戦略 スプレッドその 5 ニュートラル・スプレッド デルタの概念	名古屋市立大学経済学部 教授 國村 道雄 準大手証券会社、米系証券会社 大阪証券取引所 職員
1990 年 10 月	Vol.02No.10	現物市場のボラティリティと先物取引-米国における実証研究から- オプション実践講座-11- 日経 225 オプション戦略 スプレッドその 4 コンドル	大阪証券取引所 職員 大阪証券取引所 職員
1990 年 9 月	Vol.02No.09	日経 225 先物の裁定機会を考える オプション実践講座-10- 日経 225 オプション戦略 スプレッドその 3 バタフライ・スプレッド	大阪証券取引所 職員 大阪証券取引所 職員
1990 年 8 月	Vol.02No.08	機関投資家との懇談を終えて The Options Institute の教育訓練活動 オプション実践講座-9- 日経 225 オプション戦略 スプレッドその 2 パーティカル・スプレッド	大阪証券取引所 職員 大阪証券取引所 職員 大阪証券取引所 職員
1990 年 7 月	Vol.02No.07	-座談会-日経 225 オプション取引について オプション実践講座-8- 日経 225 オプション戦略 スプレッドその 1 理論的考察	日本勧業角丸証券 大阪株式部次長 岡尾秀治 新日本証券 株式先物課課長代理 鈴木 彰 ベアリング証券 大阪支店支店長 ウィリアム R.スティーヴンソン 国際証券 先物オプション課課長 関口 実 大同生命 大阪証券投資課 渡辺 正和 司会:大阪証券取引所 調査部長 中村 稔 大阪証券取引所 職員
1990 年 6 月	Vol.02No.06	-座談会-先物・オプション市場視察団に参加して 日経平均株価連動型ワラントについて オプションには継続的な PR が必要-PSE 関係者との懇談- オプション実践講座-7- 日経 225 オプション戦略	住友生命 岡本 芳之 大和銀行 熊澤 衛司 大阪銀行 本間 義朗 司会:大阪証券取引所 八木 二郎 大阪証券取引所 職員 インタビュー: パシフィック証券取引所(PSE) 国際マーケティング部長 Paul Koutoulas 大阪証券取引所 職員
1990 年 5 月	Vol.02No.05	裁定取引株価暴落犯人説の誤謬 年初来の株式相場の暴落と裁定取引-裁定取引は暴落の要因ではない- オプション実践講座-6- 日経 225 オプション戦略	前 日本証券経済研究所 常務理事 岡本 勝美 日興証券株式会社 先物・オプション推進室 室長 横山 直樹、桑原 善太 大阪証券取引所 職員
1990 年 4 月	Vol.02No.04	-座談会-株価急落の中で…	大手生保、証券トレーダー

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
		オプション実践講座-5- 日経 225 オプション戦略	大阪証券取引所 職員
1990年3月	Vol.02No.03	相場の急落と先物・オプション市場	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-4- 日経 225 オプション戦略	大阪証券取引所 職員
1990年2月	Vol.02No.02	S&P500 先物に比肩する市場に-平成元年の日経 225 先物市場-	大阪証券取引所 職員
		オプション取引の利用実態	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-3- 日経 225 オプション戦略	大阪証券取引所 職員
1990年1月	Vol.02No.01	アメリカにおける指数バスケット取引	大阪証券取引所 職員
		日経 225 オプション取引システムについて	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-2- 日経 225 オプション戦略	大阪証券取引所 職員
1989年12月	Vol.01No.11	先物・オプション 経営トップの理解が不可欠-IFCI 首脳と懇談-	大阪証券取引所 職員
		日経 225 オプション取引の権利行使日について	大阪証券取引所 職員
		オプション実践講座-1- オプション取引の短期的戦略	大阪証券取引所 職員
1989年11月	Vol.01No.10	スペシャル・クォーターションについて	大阪証券取引所 職員
		平穏に推移した10月16日の先物・オプション市場	大阪証券取引所 職員
		中心銘柄の価格等の状況-S&P100 オプションの取引状況(3)	大阪証券取引所 職員
1989年10月	Vol.01No.09	厚みと流動性の高まるオプション取引開設後の先物市場	大阪証券取引所 職員
		9月限の先物・オプション価格について	大阪証券取引所 職員
		中心銘柄の推移と銘柄の拡がり状況-S&P100 オプションの取引状況(2)	大阪証券取引所 職員
1989年9月	Vol.01No.08	満1年を迎えた日経 225 先物	大阪証券取引所 職員
		銘柄の拡大すすむ-OTM 中心に活況	大阪証券取引所 職員
		日経 225 先物 9月限のベース	大阪証券取引所 職員
		少ない限月移行の事例-S&P100 オプションの取引状況(1)	大阪証券取引所 職員
1989年8月	Vol.01No.07	厚みを増した建玉残高-7月の日経 225 先物の取引状況	大阪証券取引所 職員
		平穏に推移した初の取引最終日-7月の 225 オプション取引の状況	大阪証券取引所 職員
		7月限 33, 500 円の価格状況について	大阪証券取引所 職員
1989年7月	Vol.01No.06	取引を終えた1年6月限	大阪証券取引所 職員
		取引最終月における先物価格と現物指数の動き	大阪証券取引所 職員
		順調にスタートした日経 225 オプション取引	大阪証券取引所 職員
1989年6月	Vol.01No.05	主役交代の5月の取引状況について	大阪証券取引所 職員
		世界の主要先物商品の中での日経 225 先物の位置づけ	大阪証券取引所 職員
		日経 225 オプション取引情報の伝達について	大阪証券取引所 職員
1989年5月	Vol.01No.04	新年度に入った日経 225 先物取引	大阪証券取引所 職員
		日経 225 先物とカレンダー・スプレッド	大阪証券取引所 職員
		情報企業の提供する日経 225 先物情報	大阪証券取引所 職員
1989年4月	Vol.01No.03	取引を終えた1年3月限	大阪証券取引所 職員
		株先 50 を利用したスプレッド取引	大阪証券取引所 職員
		スペシャル・クォーターションの導入について	大阪証券取引所 職員
1989年3月	Vol.01No.02	株先 50 を利用した裁定取引	大阪証券取引所 職員
		日経 225 先物取引半年間の動き(昭 63.9-平 1.2)	大阪証券取引所 職員

発行年月	ナンバー	レポートタイトル	著者名
1989年2月	Vol.01No.01	日経225先物取引の5ヵ月(昭63.9-平1.1) 先物価格と現物価格の価格差(ベース)について	大阪証券取引所 職員
1989年1月	Vol.01No.00	日経225先物とTOPIX先物の取引高動向 取引を終えた63年12月限	大阪証券取引所 職員