

第2章 信用リスク分析の「参考文献と文献解題」

文献解題

EViews によるロジットと極値回帰分析の実行については「EViews9 ユーザーズガイド第 29 章第 1 節」を、ポアソン回帰については第 29 章第 6 節を参照してください。また非線形連立方程式の解法については「EViews9 オブジェクト第 1 章の 1 節」と Solve などの関連のコマンドを参考にしてください。

従属変数が(1,0)変数であるときの回帰分析については比較的わかりやすい説明が Maddala(2001)の第 8 章、あるいは Pindyck and Rubinfeld (1998)の第 8 章にあります。これら 2 つの本とも邦訳があります。過分散が生じているときのポアソン回帰分析については Cameron and Trivedi (1990,1986)が詳細に議論しています。企業の財務諸表データなどからデフォルト確率を推定する方法とその実際についての詳細は森平(2009,2011)を参照してください。

参考文献

1. 森平 爽一郎 (2009)『信用リスクモデリング—測定と管理』, 朝倉書店.
2. 森平 爽一郎 (2017)「信用リスク評価」, 証券経済学会編, 『証券辞典』, きんざい.
3. 森平 爽一郎 (2016)「リスク回避度と期待を反映したデフォルト確率」、経済系 : 関東学院大学経済学会研究論集(森崎初男教授退職記念号), 269, 19-35.
4. Boness, A. J. (1964). Elements of a Theory of Stock-Option Value. *Journal of Political Economy*, 72(2), 163-175.
5. Cameron, A. C., and Trivedi, P. K. (2005). *Microeconometrics: Methods and Applications*. Cambridge University press.
6. Cameron, A. C., and Trivedi, P. K. (1990). Regression-based Tests for Overdispersion in the Poisson Model. *Journal of Econometrics*, 46(3), 347-364.