

白石典義先生略歴および業績目録

1953 年 3 月 28 日～2020 年 8 月 26 日

略 歴

学 歴

1977 年 3 月 立教大学 社会学部 産業関係学科卒
1982 年 12 月 カリフォルニア大学 ロサンゼルス (UCLA) 経営大学院 経営学研究科修了

経 歴

1984 年 4 月 国際大学大学院 国際関係学研究科 助手
1986 年 4 月 国際大学大学院 国際関係学研究科 専任講師
1989 年 4 月 立教大学 社会学部 産業関係学科 助教授
1997 年 4 月 立教大学 社会学部 産業関係学科 教授
2001 年 4 月～2005 年 3 月 立教大学 社会学部 学部長兼社会学研究科委員長
2005 年 4 月～2006 年 3 月 立教大学 広報渉外部長
2006 年 4 月～2010 年 3 月 立教大学 経営学部 学部長兼経営学研究科委員長
2006 年 4 月～2010 年 3 月 学校法人 立教学院評議員
2006 年 4 月～2018 年 3 月 立教大学 経営学部 国際経営学科 教授
立教大学 経営学研究科 国際経営学専攻博士課程前期課程 教授
立教大学 経営学研究科 経営学専攻博士課程後期課程 教授
2007 年 4 月～2017 年 3 月 立教大学 体育会長
2010 年 4 月～2018 年 3 月 立教大学 統括副総長
2010 年 4 月～2018 年 3 月 学校法人 立教学院常務理事
2018 年 4 月 立教大学 名誉教授
2018 年 8 月～2020 年 8 月 立教学院 理事長

研究業績

論文 (日本語)

白石典義 (1988) 「システムティック・リスクの安定性 - ランダム・ベータ・モデルによる検証」『国際大学年報』5.
_____, 大槻聡幸 (1989) 「株価指数先物の時系列分析: S P 500 の価格変動」『日本オペレーションズ・リサーチ学会 オペレーションズ・リサーチ』34 (10).
_____, (1990) 「マーケット・モデルにおけるベータ係数の確率的変動: 状態空間モデルによる検証」『応用社会学研究』32.
_____, (1995) 「ボラティリティのロングメモリー・モデル」『応用社会学研究』37.
_____, (1997) 「中国に進出した日系企業の労使関係に関する研究—日本と日系企業は労使関係確立のためにどのような政策をとるべきか—」『総合研究開発機構』205.
_____, 高山俊則 (1998) 「株式収益率ボラティリティの長期依存性とロングメモリー・モデル」『日本金融・証券計量・工学学会誌: ジャフイー・ジャーナル』.
_____, (1990) 「マーケット・モデルにおけるベータ係数の確率的変動: 状態空間モデルによる検証」『応用社会学研究』32.

論文（英語）

- Noriyoshi Shiraishi (1985), "Interactive Procedure for Selecting Multicriteria Inventory Policies," Bulletin of the Graduate School of International Relations, Vol. 4.
- ____ (1986), "A SAS Program for Calculating Prediction Variance Decomposition in VARMA Models," Bulletin of the Graduate School of International Relations, Vol. 6.
- ____ (1986), "The Relationship Between Advertising and Sales : Bivariate Time Series Analysis," IUJ Discussion Paper, No. 1.
- ____ (1988), "Stability of Systematic Risk: Random Coefficient Tests for Individual Stocks," IUJ Annual Review, Vol. 5.
- ____ (1989), "Time Series Analysis of Stock Index Futures: Price Volatilities of SP500," Journal of the Operations Research Society of Japan, Vol. 34(10).
- ____ (1990), "Random Variations of Beta Coefficients: State Space Modeling Approach," The Journal of Applied Sociology, Vol.32.
- ____ (1991), "An Econometric Analysis of Los Angeles Criminal Activities in the 1970s," 『応用社会学研究』 第 32 号 .
- ____ (1995), "A Long-memory Model of stock Market Volatility," The Journal of Applied Sociology (37)
- ____ (1995), "Modeling Volatility of Japanese Daily Stock Index Returns," MTEC Journal, Vol. 8.
- ____ (1996), "Cointegration, Common Factors and the Term Structure of Yen Offshore Interest Rates," Journal of Fixed Income, Vol. 6(3).
- ____ (1997), "Persistence in a Short Memory Stochastic Volatility Model under a Long Memory Stochastic Volatility Process, " 『応用社会学研究』 , Vol. 39.
- ____ (1998), "On the Long Memory Volatility Models:Evidence from Tokyo Stock Market," 『応用社会学研究』 , Vol. 40.
- ____ (1998), "A Note on the Term Structure of Implied Volatilities for the Yen/U.S. Dollar Currency Option," Asia-Pacific Financial Markets, Vol. 5.
- ____, S.J. Brown, W.N. Goetzmann, T. Hiraki, and T. Otsuki, (2001), "The Japanese open-end fund puzzle," Journal of Business, Vol. 74(1).
- ____ (2003), "An Analysis of the Relative Performance of Japanese and Foreign Money Management in The Japanese Finance: Corporate Finance and Capital Markets in Changing Japan," International Finance Review, Vol. 4.

著作（英語）

- ____ (1989), "The Efficiency of U.S. and Japanese Stock Markets," Ryuzo Sato and Julianne Nelson (eds), Beyond Trade Friction: Japan-U.S. Economic Relations, Cambridge: Cambridge University Press.

著作（日本語）

- ____, 他 (1998), 『中国の労働・社会保障システムの基礎的研究 I』 日本労働研究機構
- ____, 他 (1999), 『中国の労働・社会保障システムの基礎的研究 II』 日本労働研究機構
- ____ (1999), 「金融時系列分析：ARCH モデル」 菊池正佳・渡辺美智子（編）『インターネット時代の数量経済分析法』 多賀出版.
- ____, 他 (2001), 『中国国有企業改革のゆくえ：労働・社会保障システムの変容と企業組織』 日本労働研究機構
- ____, 他 (2003), 『中国進出日系企業の研究：党・工会機能と労使関係』 日本労働研究機構

翻訳（日本語）

- ミルトン・フリードマン, ジェームズ・ブキャナン他（著）, 白石典義, 佐野晋一, 田谷禎三（編訳）(1991)『国際化時代の自由秩序—モンペルラン・ソサエティの提言』 春秋社