金融工学はブラック=ショールズを祖とし、「資本の効率的利用の立場から、金融の機能的効率性と資本の効率性に関する思考・技術・知識体系を創造する学問」（刈屋武昭著『金融工学とは何か－「リスク」から考える』岩波書店、2000年、8頁）です。この分野の発展とその学際的な性格から、近年、金融及び金融工学における計量経済学や統計学の重要性が高まっています。

本書は金融へ応用される計量経済学・統計学における主要な方法論の包括的概観を提供し、古典的及び最新の理論、政策、分析技術を網羅する決定的な資料となっています。全3巻、100以上の章から構成されており、第1巻は重要な理論的・実証的アプローチをカバーしています。第2巻と第3巻は資産価格設定、投資、ポートフォリオ研究、オプション価格設定、ミューチュアル・ファンド、財務会計研究といった金融計量経済学・統計学の応用を紹介しています。

本書を金融、金融工学、計量経済学・統計学に関心を持つ研究者・研究室にお薦め致します。
- Business Models: Applications to Capital Budgeting, Equity Value, and Return Attribution.
- Model Selection for High-Dimensional Problems.
- Hedonic Regression Models.
- Modeling Asset Returns with Skewness, Kurtosis, and Outliers.
- A VG-NGARCH Model for Impacts of Extreme Events on Stock Returns.
- Risk-Averse Portfolio Optimization via Stochastic Dominance Constraints.
- Implementation Problems and Solutions in Stochastic Volatility Models of the Heston Type.
- Stochastic Change-Point Models of Asset Returns and Their Volatilities.
- Unspanned Stochastic Volatilities and Interest Rate Derivatives Pricing.
- Alternative Equity Valuation Models.
- Time Series Models to Predict the Net Asset Value (NAV) of an Asset Allocation Mutual Fund VWELX.
- Discriminant Analysis and Factor Analysis: Theory And Method.
- Measuring Credit Risk in a Factor Copula Model.
- Instantaneous Volatility Estimation by Nonparametric Fourier Transform Methods.
- A Dynamic CAPM with Supply Effect Theory and Empirical Results.
- A Generalized Model for Optimum Futures Hedge Ratio.
- Instrument Variable Approach to Correct for Endogeneity in Finance.
- CEO Stock Options and Analysts Forecast Accuracy and Bias.
- Option Pricing and Hedging Performance under Stochastic Volatility and Stochastic Interest Rates.
- THE LE CHÂTELIER PRINCIPLE OF THE CAPITAL MARKET EQUILIBRIUM.
- Econometric Measures of Liquidity.