

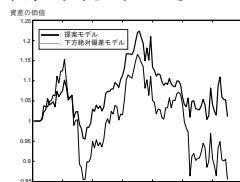
タイトル

## カーネル法を用いた資産配分関数の構築

Construction of portfolio functions using kernel methods

## 概要

現在の経済指標を入力すると、各資産の最適な投資配分を出力する関数（資産配分関数）の構築方法を考える。これまでの研究の多くでは、まず資産の確率分布を推定し、次にその分布に基づいた資産配分問題を解くことによって、最適な投資配分を求めていた。(複数の)経済指標に応じて投資配分を求めるには、その指標の条件付確率分布を推定する必要があった。本研究では、カーネル技法を使うことによって、(事前に)確率分布を求めることなく、データから直接 資産配分関数を求める手法を提案する。



資産配分関数と既存の手法による運用

URL

## 産業界への展開例・適用分野

資産運用。特に短期的な運用に向いている。また、資産運用以外にも、不確実性が伴うシステムの運用において、安定性を確保した実施計画を与えるのに役立つ。

## 研究者

	氏名	専攻	研究室	役職 (学年)
展示担当者	山下 信雄	数理工学	最適化数理分野	准教授
	吉田 雅基	数理工学	最適化数理分野	修士1年