

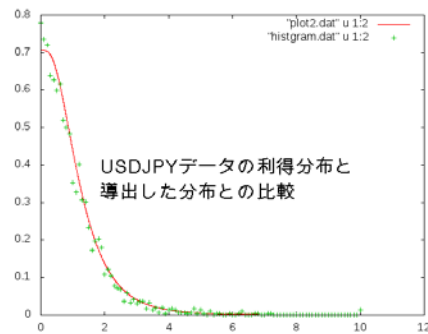
タイトル

集団行動モデルからの為替時系列の推定と応用

Estimation and application of the foreign exchange rate based on harding behavior

概要

合理的な参加者しかいないと仮定する効率市場モデルに対して、合理的な参加者と非合理的な参加者との相互作用による市場モデルが提案されている。
2種類の性質に分類される市場参加者の人数の分布から対数収益率の分布を求め、ある市場での参加者の状態遷移のパラメータを推定する。それに基づいて外国為替の特性を持つ時系列を作り出し、Default Probabilityの推定などに応用する。



URL

産業界への展開例・適用分野

外国為替時系列でのdefault probabilityの推定など

研究者

	氏名	専攻	研究室	役職 (学年)
展示担当者	中本 武志	数理工学	物理統計学 分野	修士2年
	佐藤 彰洋	数理工学	物理統計学 分野	助教