

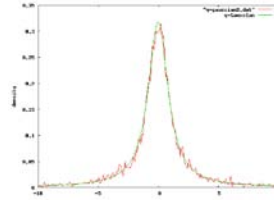
タイトル

一般化Box-Muller法を用いた時系列解析

Time series analysis with Generalized Box-Muller Method

概要

株価の対数収益率の分布はq-Gaussian分布と呼ばれる、べきテイル性を示す分布によく適合することが知られている。このような時系列に対しては、実データだけから解析に十分な量のテイル部分のサンプルデータを得られないことが多い。そこで、得られるデータから最尤推定した一般化Box-Muller法を用いて、データを補い、テイル部分のデータに関する解析を行った。このような手法は、保険商品開発で重要になるValue at Riskの推定等に役立てることができると考えている。



URL

<http://amech.amp.i.kyoto-u.ac.jp/index.php>

産業界への展開例・適用分野

Value at Riskの推定（保険業界）

研究者

	氏名	専攻	研究室	役職（学年）
展示担当者	西岡謙太	数理工学専攻	物理統計学分野	修士2年