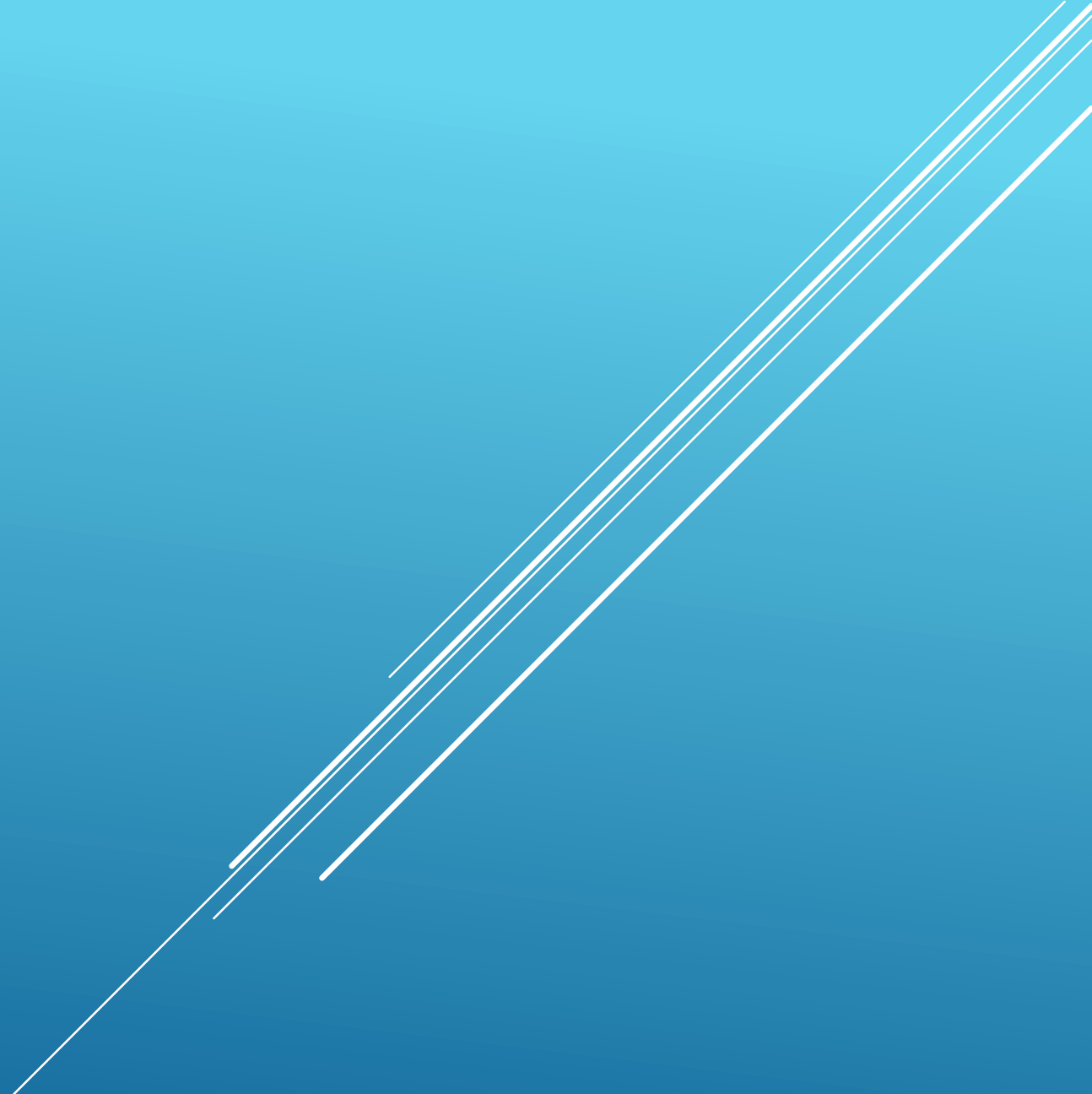


三崎研究室

計量経済・金融工学



計算機集約的な統計手法の開発と、

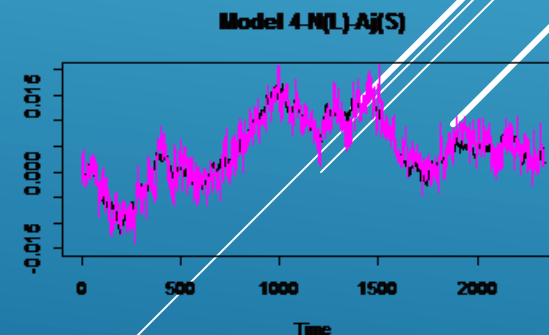
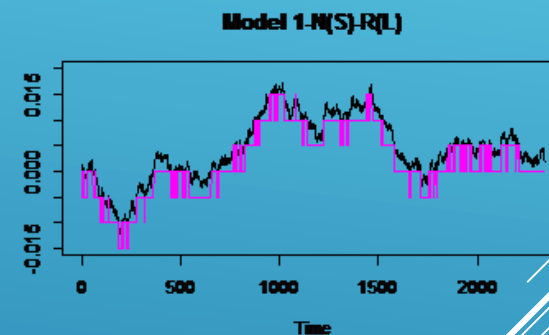
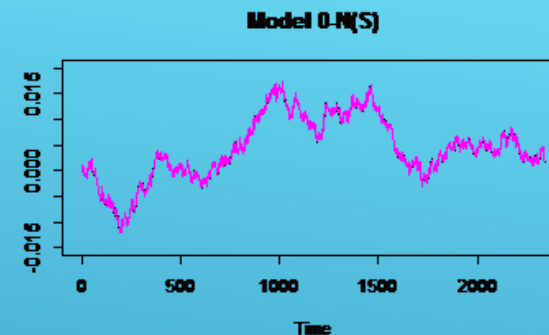
経済・ファイナンス分野等の実データへの応用を研究しています。

▶ 研究分野

- ◆ 統計学, 計量経済学, 計量ファイナンス, 金融工学
- ◆ 時系列データ解析, 大規模データ (ビッグデータ) 解析

▶ 研究のキーワード

- ◆ 状態空間モデル, 粒子フィルタ, 機械学習
- ◆ 高頻度データ, 資産価格の変動 (ボラティリティ), 信用リスク
- ◆ 金融リスク管理, 保険, 価格付け, 資産配分, ポートフォリオ



▶ 研究テーマの例

- ◆ 高頻度ボラティリティ推定量の性質とポートフォリオへの応用
- ◆ 粒子フィルタによる信用リスクの推定
- ◆ 地方債のイールドカーブ・スプレッドの推定・予測
- ◆ 高頻度データに基づくボラティリティ時系列モデルの拡張
- ◆ 天候デリバティブによる水稻の冷害リスクのヘッジ
- ◆ 機械学習による信用リスクの分類
- ◆ 取締役会の多様性が収益率に与える影響
- ◆ 風力発電所の最適分散配置
- ◆ 電力卸売市場と需給予測

