

令和3年度 計量経済学特別講義

～計量ファイナンスの最近の展開～

以下の特別講義を開講します。単位や成績とは無関係ですが、金融計量分析における最近の話題を概説します。レベルは計量経済学、金融論を一通り勉強した大学院修士向けですが、学部生、博士課程大学院生、研究員の方など、本学の関係者であればどなたでも参加して頂いて結構です。興味のある人は是非参加してください。

講師： 大屋 幸輔先生(大阪大学経済学研究科教授)

日時： 2月4日(金) 2、3、4 限目

方法： オンラインZoomにて開講(録画配信はしません)

(参加希望の方は、1月31日(月)までに所属・学年等を寺沢まで
<terasawa@kier.kyoto-u.ac.jp> 連絡してください。
後日ZoomのURLを送ります。)

内容： 金融市場で観測されるデータをもちいて市場での価格形成過程を解析するマーケット・マイクロストラクチャーとよばれる分野の基本的なモデルとそれらに対する計量手法について解説します。必要とされる予備知識は統計学、計量経済学ですが、時系列分析の手法が主に使われます。講義では必要とされる時系列分析の手法や関連する事項の解説を交えながら、代表的なマーケット・マイクロストラクチャー理論を切り口に金融市場で観測されるデータ分析に関する説明を行う予定です。

問合せ： 西山(nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp)までご連絡ください。