



経営と法セミナー2019



12月6日(金)17:00~18:30

確率的ボラティリティモデル と価格レンジに基づく補正

資産価格収益率の代表的なモデルである確率的ボラティリティモデルを日次収益率だけでなく、日次高値・安値の価格レンジの情報を用いて拡張し、推定する方法について報告する。

■講師:黒瀬雄大
筑波大学 システム情報系 助教

会場 | 大阪経済大学 大隅キャンパス
J館4階 47セミナー教室

事前申込み | 不要

12月20日(金)17:00~18:30

大規模空間データに対する Linear Projectionを用いた 多重解像度近似

サンプルサイズが大きい大規模空間データに対して最尤法、クリギングといった統計解析手法を適用すると、計算コストが非常に大きくなる場合がある。本発表では高速計算手法の1つであるmodified linear projectionの解像度を高めることで拡張した新しい高速計算手法を提案する。

■講師:平野敏弘
関東学院大学 経済学部 講師



大阪経済大学

経営・ビジネス法情報センター

大阪市東淀川区大隅2-2-8

お問合せ先：大阪経済大学 経営・ビジネス法情報センター

TEL：06-6328-2431 (代)

WEB: <https://www.osaka-ue.ac.jp/blic/index.html>(センター)
<https://www.osaka-ue.ac.jp/education/graduate/>(大学院)

MAIL: blic@osaka-ue.ac.jp