

# 卒業論文プロポーザル

慶應義塾大学経済学部 渡邊直斗

2018 年 7 月

## 1 研究題目

ベイズの動的潜在因子モデルに基づいた時系列予測合成の実証分析

## 2 研究の目的

研究題目にあるベイズの動的潜在因子モデルに基づいた時系列予測合成の有用性について実証分析を行う。分析データには為替情報の実データを用いる。このモデルと、機械学習や従来の時系列モデルとの比較検証を試みる。

## 3 関連する先行研究

”Dynamic Bayesian Predictive Synthesis in Time Series Forecasting”  
author:Kenichiro McAlinn & Mike West

ベイズの動的潜在因子モデルに基づいた時系列予測合成についての背景や、手法について議論を行なっている。

### 工程表

- 8月上旬 — 先行研究の理論とアルゴリズムの理解
- 8月下旬 — プログラムの作成と検証作業
- 9.10.11月 — 論文の執筆と中間報告
- 12月 — 追加的な検証作業と論文のブラッシュアップ

## 参考文献

- [1] Dynamic Bayesian Predictive Synthesis in Time Series Forecasting