

Experimentální finanční trh

Marek Bryša

Masarykova Univerzita
Přírodovědecká fakulta

17. dubna 2012

Cíl práce

Analyzovat vliv obchodních strategií na tržní cenu málo obchodovaných aktiv a tvorbu cenových bublin.

- ① Analýza dostupných data z ekonomického experimentu *finanční trh*.
- ② Vytvoření softwarových agentů podle zjištěných obchodních strategií.
 - Neuronové sítě
 - "Regrese na konečný automat"
 - Manuálně
- ③ Simulace experimentu s různými poměry obchodních strategií a zpětná kontrola s dostupnými reálnými daty.
- ④ Statistická analýza naměřených hodnot, vyvození předbežných závěrů.
- ⑤ Provedení experimentu v kombinaci softwarových a lidských agentu podle předchozího.
- ⑥ Vyvození závěrů z ekonomické a statistické analýzy získaných dat.

- Neural networks for economic and financial modelling
- Software agents and market (in) efficiency: a human trader experiment,
- Agent-based models and human subject experiments
- An adaptive agent based economic model
- Simulating the madness of crowds: Price bubbles in an auction-mediated robot market,
- Expectations and bubbles in asset pricing experiments