

【計量ファイナンスA】

中間課題

中島 上智

(経済研究所)

中間課題

- ▶ 中間課題のデータを用いて, 2 つの ARCH 型モデルを推定し, その結果をまとめて提出する. 推定に使用したコードのファイルも併せて提出すること.
- ▶ データは, 株価の日次データであり, 1 列目が日にち, 2 列目が終値の価格である. この価格データからリターンを計算し, リターンにモデルをあてはめること.
- ▶ 推定するモデルは, ボラティリティの式の次数が異なれば, 異なるモデルとみなす.
- ▶ 推計されたパラメータの値とボラティリティの系列について, 2 つのモデルの間でどのような共通点や差異があるか説明すること.

提出方法

- ▶ 提出締切を 4/23 日 (日) の 17:00 とする.
- ▶ レポートとコードのファイルをメールに添付し,
nakajima-j@ier.hit-u.ac.jp まで送信する.
- ▶ メールを送信後, 48 時間以内に中島より受領確認のメールが送られてこなければ, メールで問い合わせること.
- ▶ なお、提出するコードのファイルに, データ自体は含めなくてよい.