

# 【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, GARCH(1,1) 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.
- ▶ データには, 2 つの銘柄について, 日次の終値が収録されている. それぞれの銘柄について, 終値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 つの銘柄の間でどのような共通点や差異があるか説明すること. また, 参考情報として, リターンの平均, 標準偏差, 最大値, 最小値についても記載すること.

## 提出方法

- ▶ 提出締切を 5/7 日 (火) 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.