

【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

- ▶ 講義資料のページに掲載されている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。
- ▶ 提出するコードのファイルに、上記のデータは含めなくてよい。

提出方法

- ▶ 提出締切を 11/25 日 (金) 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.