

高次元ポートフォリオの作成

慶應義塾大学 総合政策学部 4 年 深澤風土

2016 年 11 月 24 日

1 Abstract

概要を説明。

2 Introduction

問題提起。

3 Background

先行研究をまとめる。

4 Methods

4.1 LASSO

共分散行列に対するスパースな推定。

4.2 Algorithms

CD に関する説明。

5 Experiments

5.1 Comparison

データの説明など。経験共分散行列と、上記の手法でスパースに落とした共分散行列の二つを使って、それぞれポートフォリオを作成する。

6 Conclusion

分析結果から得られる結論。

参考文献

- [1] Robert Tibshirani, Regression Shrinkage and Selection via the Lasso,
Journal of the Royal Statistical Society, Volume 58, 1996, 267-288.