

Understanding Financial Crises

Ch10 : Contagion 後半

Kei Ikegami

March 8, 2018

発表の流れ

何をするか

- 銀行間のつながりが incomplete network でも first best を達成することはできた。しかし世界全体での流動性需要量が想定される量よりも多くなる想定外の事象の下では、incomplete network だと bankrupt が地域を超えて連鎖する Contagion が発生する。ということの確認。
- Contagion が全地域に拡大すると世界に存在する資産の価値が低下するのでやだ！ ということの確認。
- 銀行のデータを使って Contagion が発生する規模をシミュレーションする研究の紹介













