

feat: 高度なリスクモデル実装 - GARCH/EVT/レジーム考慮型VaR #36

Edit<> CodeJump to bottom

Mergedminguin merged 1 commit into main from claude/issue-35-20250525_115252 5 days ago

Conversation0Commits1Checks0Files changed6

minguin commented 5 days ago

概要

リスクダッシュボードに高度なリスクモデルを実装しました。

主な変更点

バックエンド

- backend/advanced_risk_models.py - GARCH/EVT高度リスクモデル
- backend/app.py - 高度リスクAPIエンドポイント追加
- backend/requirements.txt - scipy依存関係追加

フロントエンド

- frontend/src/AdvancedRiskDashboard.tsx - 高度リスク分析画面
- frontend/src/App.tsx - メニュー統合

新機能

- GARCH(1,1)モデル: 時変ボラティリティ推定
- 極値理論(EVT): テールリスクの詳細分析
- レジーム考慮型VaR: 市場状況に応じたリスク計算
- モデル比較: Historical/GARCH/EVT/Combinedの4手法比較
- ボラティリティ予測: 10日先までの予測

テスト状況

- ユニットテスト実装済み
- API統合テスト実装済み
- エラーハンドリングとフォールバック機能付き

Generated with [Claude Code](#)

Reviewers

⚙️

No reviews

Assignees

⚙️

No one—[assign yourself](#)

Labels

⚙️

None yet

Projects

⚙️

None yet

Milestone

⚙️

No milestone

Development

⚙️

Successfully merging this pull request may close these issues.

None yet

1 participant

