

計量ファイナンスシステムエリア

エリアの概要

計量ファイナンスエリアは、ファイナンスに関係する様々な問題に対して、定量的アプローチからその解決策を探ることを目的にしている。以下に挙げるとの科目も、データ解析が基本となるために、専門基礎科目で提供されている数学の知識が不可欠である。

科目構成

科目名	概要	標準履修年次
計量経済学	経済モデルをデータから推定する標準的手法である回帰分析を扱う。基礎となる統計学を復習した後に古典的回帰モデルを解説する。さらに多変数回帰の様々な応用例とモデルの拡張方法を紹介する。	2～4年
マクロ計量分析	時系列データを使った経済理論モデルの統計的な検証方法とそのマクロ経済・金融分析への応用例を解説する。	2～4年
金融論	ミクロ・マクロ経済学という分析手段を使って、金融システムを理論的・実証的に分析することで、経済における金融システムの役割を考察するとともに、金融政策の効果を検証する。	2～4年
金融リスク管理論	金融資本市場（株式、債券、為替、商品、及びそのデリバティブ）に内在する様々なリスクを分類し、個別リスクやポートフォリオ・リスクの具体的な計量方法を学ぶ。	2～4年
計量時系列分析	実証分析に使用する時系列解析の諸手法を概説するとともに、統計ソフトウェアを用いたデータ解析を通じて具体的な適用方法についても説明する。	2～4年
計量ファイナンス エリア演習	ファイナンス関係の理論及び実証研究で用いられる計量手法を、データ解析を通じて学ぶ。	3～4年優先

