

システム情報工学研究科修士論文概要

年 度	平成 22 年度	学位名	修士(ビジネス)
専 攻	経営・政策科学	専攻	著者氏名 Mak Fu Hang
指導教員氏名 岸本 一男			
論文題目 Modeling and Forecasting Realized Volatility in the Tokyo Stock Exchange (Realized Volatility の推定と予測: 東証株価に対する実証分析)			
論文概要 This master's thesis tries to clarify the behavior of the time series of the realized volatility individual stocks in the Tokyo Stock Exchange. Several preceding relevant studies show that the logarithmic realized volatilities are well modeled by long memory time series models. We find that the logarithmic realized volatilities could be better modeled by self-exciting threshold autoregressive (TAR) models.			
審査日 平成 23 年 2 月 3 日			
審査員	(大学名 職名)	(学位)	(氏名)
主査	筑波大学 准教授	博士(経済学)	辻 爾志
副査	筑波大学 教授	工学博士	岸本 一男
副査	筑波大学 教授	Ph.D. in Statistics	金澤 雄一郎