

システム情報工学研究科特定課題研究報告書概要

年 度	平成 26 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 汪卿竹
指導教員氏名	吉瀬章子	副指導教員氏名	竹原浩太
報告書題目	日本および海外株式市場における実証研究 (イベントの前後で機械的な分け方の妥当性を検証する)		
報告書概要	<p style="text-align: center;">要旨</p> <p>本研究では、欧州株式市場における代表する六か国の 133 社の 10 年間データを対象とし、従来的にイベントの前後で機械的な分け方の妥当性を検証する。本研究では、単純にデータ中心の区切り方を基づいて、大きいイベントの影響を確認するため、実際に市場の構造が変化した時期を推測し、また新しい提案する。</p> <p style="text-align: center;">Abstract</p> <p>In this chapter, we analyze the 133 companies in the 10-year data of six countries that representative in the European stock market. Our purpose is to verify the validity of the way in dividing the stock data before and after the big events. In order to see the effect of large events and infer the time when the structure of the market has actually changed, and make new proposals.</p>		
審査日	平成 27 年 1 月 26 日		
審査員	(大学名 職名)	(学位)	(氏名)
主査	筑波大学 教授	博士(工学)	イリチュ 美佳
副査	筑波大学 教授	工学博士	吉瀬 章子
副査	筑波大学 助教	博士(経済学)	竹原 浩太