

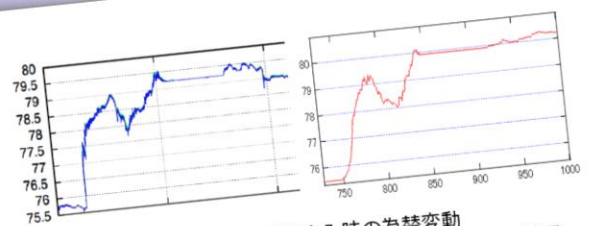
第10回

高安 秀樹 氏

(ソニーCSL・東京工業大学)

金融市場の基本特性と
観測所の必要性

今世紀に入って入手可能となった金融市場の詳細な売買取引データを分析することで、市場の価格変動の本当の姿が明らかになってきた。需要と供給の差が市場価格を動かすという経済学における最も基本的な考え方にも修正が必要である。例えば、同じ買い注文であっても、現在の市場価格に近い注文と遠い注文ではその意味と役割が全く異なり、市場価格への影響も正反対になる。本講演では、まず、最近解明された金融市場の基本特性を紹介し、次に、気象や地震などと同じような公的な市場変動観測所が必要であることを説明し、観測や予測のための基本技術を紹介する。



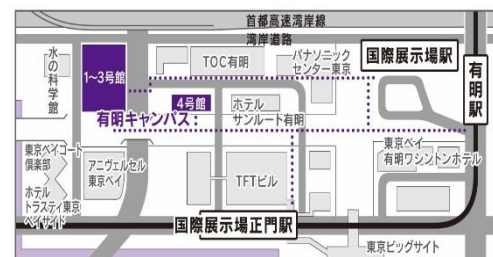
(左) 2011年10月31日の日銀介入時の為替変動
(右) エージェント型モデルによるシミュレーションの結果

りんかい線「国際展示場駅」徒歩7分

10月19日(水) 16:30-18:00

武蔵野大学有明キャンパス, 4号館 4階 403室

事前登録不要・参加無料: どなたでも自由にご参加いただけます。



組織委員: 薩摩順吉, 阿部修治, 西川哲夫, 渡辺知規,
木下修一, 田中健一郎, 友枝明保, 松家敬介, 八島亮子

問い合わせ先: 武蔵野大学数理工学センター
http://www.musashino-u.ac.jp/facilities/mathematical_engineering.html

