

金融バブルの大規模データ解析

高田輝子^{*1}

^{*1} 大阪市立大学大学院経営学研究科

金融バブル解析の難しさは、少ない情報で複雑なシステムを解明しなければならない点にある。本研究では、高頻度金融データやウェブ上のテキストデータなどの大規模データの利用により情報量増大を図ると同時に、ロバスト・効率的情報抽出のための新しい統計手法を開発することで、その困難の解決を目指した。講演では開発した新手法や、金融バブルに関して発見したいくつかの新事実を紹介する。