

講義紹介

取引システムの計量分析 経済学部経済棟第3教室 水曜日 10:20-12:00



担当:計盛英一郎(経済学部金融学科)

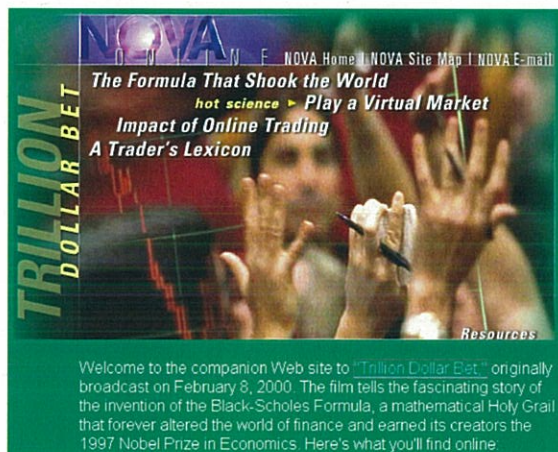
金融市場をゲーム理論・マイクロストラクチャーの観点から分析することを目的とする。日米の金融市場の取引システムの概観からはじめ、理論・実証の重要な論点を検討する。主なトピックは以下の通り。

1. 金融市場の取引システムの構造
2. 戦略的な価格形成と市場の効率性
3. 動学的な取引行動
4. 機関投資家の行動と金融システムへの影響

教材：開講時に配布するシラバスによる

成績評価：出席、レポート、発表など

4/11 10:20-12:00 ドキュメンタリー *Trillion Dollar Bet*



4/18 10:20-12:00 *Bloomberg* 担当者による端末の実演と講習会



4/25 10:20-12:00 渋沢健氏によるヘッジファンド・オルタナティブ投資に関する講義