



経済・金融データの分析 (アルゴリズムの効率化)

2 組合せ最適化問題とは？

東京証券取引所

トヨタ自動車	東京電力
JR東日本	NTTドコモ
みずほFG	ローソン
電通	フジテレビ
味の素	花王
ソニー	吉本興業

どの株を買えばいいのだろうか？

投資家

トヨタ ドコモ みずほ フジ
ポートフォリオ

ポートフォリオの作成は、多くの株の中から予算内で良い株の組合せを見つける問題です。

(左図は学生が作成した卒研発表スライドの一部)

株価や為替などの経済データの動きをコンピュータ上で分析しています。

(右図は東京証券取引所見学の際の記念写真)



多くの組合せから最も良い組合せを見つけるようなアルゴリズム (物事のプログラム手順や計算手順) の効率化がテーマです！

《裏面もご覧ください》

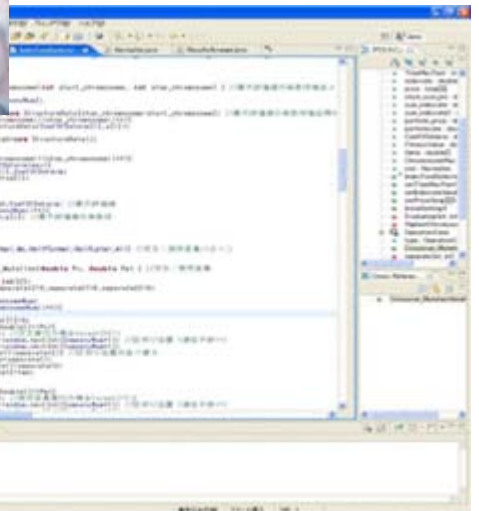


研究について話し合う4年生

自分の卒研内容を教えあっています！

スーパーカフロボ大会（株式自動売買プログラムで運用利益を競う大会）に参加する学生もいます。

■最終成績表■	
取引開始日	: 2004-08-31
取引終了日	: 2005-09-01
経過日数(日)	: 367
運用日数(日)	: 247
総トレード数	: 102
勝ちトレード数	: 88
負けトレード数	: 14
年間平均トレード数	: 82
年間平均トレード期間(日)	: 58
年間平均トレード期間(日)	: 4
年間平均トレード期間(日)	: 117
年間平均トレード期間(日)	: 123
年間平均トレード期間(日)	: 79
年間平均トレード期間(日)	: 1
総金額(円)	: 98626150
1ヶ月数率(%)	: 86.27
5ヶ月数率(%)	: 66.67
5ヶ月数率(%)	: 66.67
5ヶ月数率(%)	: 58.33
純利益(%)	: 5.8
純利益(%)	: 7.21
純損失(%)	: -1.61



右上：カフロボ結果

中央：ゼミの様子

右下：学生が作成したJavaプログラム

是非一度ご覧ください。