

人工市場シミュレーション

計算機上に仮想的なディーラーの役割をするコンピュータプログラムを作り、これらのエージェントが自由に取引を行う仮想市場において実験を行う、人工市場研究を行っています。現実の経済記事を基にしたデータを入力し、各エージェントに経済状況を判断する認知機構を持たせた人工市場を構築しました。この人工市場により、現実のある時期のバブル発生・崩壊のメカニズムを解明したり、市場介入政策の決定を支援するシステムを構築しました。

- ・ プログラム : 人工市場 AGEDASI TOF の配布
- ・ 和泉 潔, 『人工市場 市場分析の複雑系アプローチ』, 森北出版, 2003.
- ・ 水田 孝信, 和泉 潔, 八木 勲, 吉村 忍, 人工市場を用いた値幅制限・空売り規制・アップティックルールの検証と最適な制度の設計, 電気学会論文誌C (電子・情報・システム部門誌), Vol. 133 (2013) No. 9 P 1694-1700.
- ・ 和泉 潔, 鳥海 不二夫, 松井 藤五郎, 人工市場とエージェントの取引戦略, 知能と情報, 20 巻 4 号, pp. 609-615, 2008.
- ・ 和泉 潔, 松井 宏樹, 松尾 豊: 人工市場とテキストマイニングの融合による市場分析, 人工知能学会誌, 22 巻 4 号, pp. 397-404, 2007.