

**グローバルCOE Hi-Stat 経済統計若手研究会「MCMCの経済データへの応用」  
(グローバルCOE Hi-Stat/文部科学省科学研究費基盤研究(A)「金融リスクと経済行動の  
ベイズ計量経済分析」(代表者:大森裕浩)共催)**

日時:平成 21 年 9 月 15 日(火)

場所:一橋大学マーキュリータワー7階 コンファレンスルーム

幹事:渡部敏明(一橋大学経済研究所・教授)、大森裕浩(東京大学大学院経済学研究科・教授)

時間配分:一人あたり 30 分(発表-20 分、質疑応答-10 分)

**プログラム**

10:30-10:35 開会の辞:渡部敏明(一橋大学・教授)

10:35-12:35 **ファイナンスデータへの応用** 座長:渡部敏明(一橋大学・教授)

大森裕浩(東京大学・教授) “Generalized extreme value distribution with time-dependence using the ARMA model in state space form”

石原庸博(東京大学・D2) 「非対称行列指数確率的ボラティリティ変動モデルのベイズ推定」

國濱 剛(東京大学・D1) 「max-stable process のベイズ分析と高頻度株価収益率データへの応用」

黒瀬雄大(東京大学・D1) 「時変分位点のベイズ解析」

12:35-14:00 昼食

14:00-16:00 **マイクロデータへの応用** 座長:大屋幸輔(大阪大学・教授)

各務和彦(千葉大学・准教授) “Posterior analysis of fatal traffic accidents on Hokkaido in Japan”

大西裕子(東京大学・D1) “Bayesian estimation of entry games with multiple players and multiple equilibria”

広瀬要輔(東京大学・D1) “Estimating inefficiency in online auctions”

宮脇幸治(日本大学・PD) “A Bayesian estimation of the residential gas demand function with nonlinear indirect utility”

16:00-16:15 休憩

16:15-17:45 **マクロデータへの応用** 座長:各務和彦(千葉大学・准教授)

西埜晴久(千葉大学・准教授) “Estimation of dynamics for income inequality by stochastic volatility model”

大塚芳宏(一橋大学・D1) “Spatial versus simultaneous correlations in forecasting electricity demand in Japan”

渡部敏明(一橋大学・教授) “Bayesian analysis of time-varying parameter vector autoregressive model for the Japanese economy and monetary policy”

17:45-17:50 閉会の辞:大森裕浩(東京大学・教授)