

## グローバル COE Hi-Stat 経済統計若手研究会

一橋大学グローバル COE プログラム「社会科学の高度統計・実証分析拠点構築」、  
科研費基盤研究(A)「金融リスクと経済行動のベイズ計量経済分析」(研究代表者：大森  
裕浩 (東京大学)、課題番号：21243018 ) 共催

日時：2012年3月9日(金) 10:00-18:00

会場：一橋大学経済研究所4階会議室

幹事：大森裕浩(東京大学)、渡部敏明(一橋大学)

報告時間：一人当たり報告25分+質疑応答10分

10:00-10:05 開会の挨拶

### 時系列分析 I

座長：西埜晴久(千葉大学)

10:05-10:40 七宮圭(一橋大学) “Modelling for the wavelet coefficients of ARFIMA processes”

10:40-11:15 長倉大輔(慶應大学) “Robust inference on structural spurious regression when regressors almost have unit root”

### 時系列分析 II

座長：長倉大輔(慶應大学)

11:15-11:50 永田修一(関西学院大学) “Finite sample bias of fully aggregated estimator for AR(1) model with a general error distribution”

11:50-12:25 西埜晴久(千葉大学) “Estimation of ARMA models with t-innovations”

12:25-13:35 昼食

### Nonparametric Bayes

座長：各務和彦(千葉大学)

13:35-14:10 菅原慎矢(東京大学) “Analysis of a price mechanism of the Japanese private nursing home market via nonparametric Bayesian estimation for a simultaneous model of demand and supply”

14:10-14:45 入江薫(東京大学) “Nonparametric stochastic volatility: mixture approach”

### **Stochastic Volatility**

座長：大森裕浩（東京大学）

14:45-15:20 大塚芳宏（一橋大学）“Estimating spatial dependence and volatility in retail gasoline price with CAR-SV model”

15:20-15:55 黒瀬雄大（東京大学）“Dynamic equicorrelation stochastic volatility”

15:55-16:10 休憩

### **Realized GARCH and Stochastic Volatility Models**

座長：渡部敏明（一橋大学）

16:10-16:45 城田慎一郎（東京大学）“Realized stochastic volatility with leverage and long memory”

16:45-17:20 竹内明香（一橋大学）“An empirical analysis of the Nikkei 225 options using realized GARCH models”

### **経済統計**

座長：渡部敏明（一橋大学）

17:20-17:55 飯塚信夫（神奈川大学）「日本の貿易収支赤字は定着するのかー最新データに基づくファクト・ファインディングー」

17:55-18:00 閉会の挨拶

18:30- 21:00 レセプション