

釧路公立大学研究集会
「ファイナンス・経済統計の諸問題」

日時：2018 年 2 月 20 日(火)

会場：釧路公立大学第一会議室

<http://www.kushiro-pu.ac.jp/aboutus/overview/access.html>

主催：釧路公立大学

共催：一橋大学経済研究所共同利用・共同研究拠点プロジェクト研究「資産価格の高頻度データを用いたボラティリティ変動モデルの開発とリスク管理への応用」(研究代表者：大森裕浩 (東京大学))

科学研究費基盤研究(A)「経済・金融多変量データのベイズモデリングと政策・行動の確率的評価」(26245028) (研究代表者：大森裕浩 (東京大学))

幹事：生方雅人 (釧路公立大学)

開会の挨拶

10:25-10:30 生方雅人 (釧路公立大学)

<セッション：ファイナンスの諸問題 I >

座長：大屋幸輔 (大阪大学)

10:30～11:05 木下亮 (東京経済大学) “Long-run risk prices in the Japanese stock market”

11:05～11:40 椋木伸吾 (大阪大学) “Estimation for affine term structure with smooth transition”

11:40～12:15 高見澤秀幸 (一橋大学) “An equilibrium model of term structures of bonds and equities”

12:15～13:15 昼食

<セッション：経済統計の諸問題>

座長：渡部敏明 (一橋大学)

13:15～13:50 飯塚信夫 (神奈川大学) “Nowcasting GDP in Japan using professional forecasters information”

13:50～14:25 大塚芳宏 (東北学院大学) “Forecasting business conditions and cyclical phase with leading and coincident indicators”

14:25～14:40 休憩

<セッション：ファイナンスの諸問題II>

座長：大森裕浩（東京大学）

14:40～15:15 粟屋直（東京大学）“Particle rolling MCMC with forward and backward block sampling with application to stochastic volatility models”

15:15～15:50 山内裕太（東京大学）“Factor multivariate realized stochastic volatility model”

15:50～16:25 高橋慎（大阪大学）“Realized stochastic volatility with skew-t error”

16:25～16:40 休憩

<セッション：ファイナンスの諸問題III>

座長：生方雅人（釧路公立大学）

16:40～17:15 長倉大輔（慶應義塾大学）“State space method for the quadratic estimator of the integrated variance in the presence of market microstructure noise”

17:15～17:50 生方雅人（釧路公立大学）“Implied and realized jump risks in aggregate Japanese stock returns”

18:30～ 懇親会