

成果の説明書

(氏名)石原庸博	(学部)経済学部
<p data-bbox="264 253 432 286">1 重要事項</p> <p data-bbox="256 338 1367 504">科学研究費 基盤研究(A) 19H00588 ” 高次元データモデリングの新展開と統計的リスク分析”，代表者 大森裕浩教授（東京大学） 科学研究費 基盤研究(B) 20H01514 ” 介護保険制度下における介護サービスの供給構造に関する研究”，代表者中村 二郎教授（日本大学） について研究を行い，以下の査読論文の掲載と学会発表を行った。</p> <p data-bbox="256 560 375 591">査読論文</p> <p data-bbox="256 602 1276 768">Shinya Sugawara, Tsunehiro Ishihara, Susumu Kunisawa, Etsu Goto and Yuichi Imanaka (2024),"A panel vector autoregression analysis for the dynamics of medical and long-term care expenditures," Health Economics, V. 33(4),pp. 748-763,DOI: 10.1002/hec.4794</p> <p data-bbox="256 819 1367 1028">内容はパネルベクトル自己回帰モデルを用いて，医療・介護支出の個票レセプトデータを用いての医療・介護支出のパターンを把握する研究である．ラグ・時系列構造を spike and slab 型のベイズ法による変数選択法を用いて選択する手法を適応した．急性期医療支出から医療リハビリ，介護リハビリへの支出の移行パターンを、インパルスレスポンス関数を用いて示した．特に，ベイズ法による推定・ラグ選択方法について担当した．</p> <p data-bbox="256 1081 375 1113">学会発表</p> <p data-bbox="256 1124 1254 1247">Tsunehiro Ishihara, (2023) "A realized multi-factor regression model using multivariate realized stochastic volatility", 17th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2023)</p> <p data-bbox="256 1256 1367 1379">概要 株式インデックスの高頻度データから高頻度のファクターとその実現共分散を推定し，高次元にも対応しやすい多変量確率的ボラティリティ変動モデルとその推定法を提案し，予測を行ってパフォーマンスを調べている．</p> <p data-bbox="256 1471 598 1503">ディスカッションペーパー</p> <p data-bbox="256 1514 1367 1637">Toshihiro Hirano and Tsunehiro Ishihara, (2024), “Multi-resolution filters via linear projection for large spatio-temporal datasets”, arXiv:2401.05315 を海外論文誌に投稿中である．</p> <p data-bbox="256 1691 544 1722">その他 進行中の研究</p> <p data-bbox="256 1733 1048 1765">渡部敏明教授(一橋大学)と景気循環に関する研究を行っている．</p> <p data-bbox="256 1818 320 1850">教育</p> <p data-bbox="256 1861 1367 1984">『計量経済学 I, II』, 『経済統計』, 『データ分析入門』, 『市場と経済』, 『基礎演習』『演習 I』を担当した．講義資料は全てウェブで配布し，体調不良等による欠席時等があっても学習に支障が少ない様心掛けた．</p>	

2 その他の事項

3 次年度以降の計画・抱負

A realized multi-factor regression model using multivariate realized stochastic volatilityの研究については2種類のアプローチを考えて2つの研究としてまとめたいと考えている.

その他変数選択法の応用に関する研究を行う.

次年度は, 卒業研究の指導が始まるため, そちらにも力を入れる. また『計量経済学』『経済統計』については教材・内容の改善に取り組む.