

成果の説明書

(氏名)石原庸博	(学部)経済学部
<p>1 重要事項</p> <p>科学研究費 24H00142 基盤研究(A)”</p> <p>統計的学習を用いた非線形計量経済モデルの新展開と金融・経済リスク評価への応用”</p> <p>代表者 大森裕浩教授 (東京大学)</p> <p>に分担者として参加し、以下の研究を行った.</p> <p>学会報告 3 件</p> <p>1. Tsunehiro Ishihara (2024) “Multivariate realized stochastic volatility model using time varying coefficient characteristic factor regression” , 7th International Conference on Econometrics and Statistics (Ecosta 2024)</p> <p>2. 石原庸博 (2024) “リスクファクターの実現共分散を用いたファクター回帰型の多変量 Realized Stochastic Volatility モデル” 2024 年度統計関連学会連合大会</p> <p>3. Tsunehiro Ishihara (2024) ”High-dimensional multivariate realized stochastic volatility model using characteristic factor regression”, 18th International Joint Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE) and Computational and Methodological Statistics (CMStatistics)</p>	
<p>2 その他の事項</p> <p>ディスカッションペーパー Toshihiro Hirano and Tsunehiro Ishihara, (2025), “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>進行中の研究 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>教育 『計量経済学 I, II』, 『経済統計』, 『基礎演習』『演習 I』, 『演習 II』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>	
<p>3 次年度以降の計画・抱負</p> <p>進行中の研究をまとめるほか, マーケットのミクロ構造に関する研究を始めている.</p> <p>次年度以降も継続的に『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.</p>	