



研究キーワード

フィリップス曲線, 金融政策, 為替政策, 波及経路

矢野 順治

YANO, Junnji

副学長(教育, 入試, 研究, 情報担当),
アドミッションセンター長
特任教授

所属…経営学部 経営学科

yanoj@kankyo-u.ac.jp

Profile

■主な担当科目 金融入門, 金融市場論, 証券投資概論

研究者略歴

1987(昭和62)年12月	シカゴ大学経済学部博士課程修了
1987(昭和62)年12月	名古屋大学経済学部助手
1989(平成 元)年 4月	長崎大学大学経済学部講師
1998(平成 9)年 4月	広島大学経済学部教授
2015(平成27)年 4月～	公立鳥取環境大学経営学部教授
2016(平成28)年 4月～	公立鳥取環境大学大学院環境経営研究科経営学専攻教授
2018(平成30)年 4月～	公立鳥取環境大学経営学部長, 大学院環境経営研究科副研究科長, 経営学専攻長

Research

■取得学位 経済学博士(シカゴ大学)

■専門分野 金融論

■現在の研究テーマ
・フィリップス曲線と金融政策分析
・金融政策の波及経路

■所属学会 日本経済学会, 日本金融学会, 生活経済学会

Data

研究等活動

【著書】

・「E-viewsで学ぶ実証分析の方法」(共著) 2013年 日本評論社「国際金融 理論編」(共著) 2008年 有斐閣「E-viewsで学ぶ実証分析入門 (基礎編, 応用編)」(共著) 2008年 日本評論社

経済・金融データの統計分析



副学長(教育、入試、研究、情報担当)
アドミッションセンター長
経営学部 経営学科
特任教授

矢野 順治
YANO, Junji

SDGs 関連項目



● 研究内容

主に経済・金融データを中心とした統計分析を行っている。ここでは二つの研究テーマを紹介したい。まず時系列分析であるが、時系列データとは時間の推移とともに観察されるデータであり、経済・金融データの多くは時系列データである。これらのデータを分析する手法としては、複数の変数を含む理論モデルに基づいたモデル分析と時系列データを発生させる確率的モデルの構造そのものを分析しようとする時系列分析に大別される。時系列データの中でも、株価等の金融関係のデータは通常のマクロ経済変数と比べて分散不均一性と呼ばれる著しい特徴がある。このような場合の代表的時系列分析手法としては、ARCH、GARCH等のボラテリティ変動モデルがある。これらのモデルについては様々な拡張が試みられているが、あくまで単一の変数の分析を対象とするものである。これに対して、MGARCHモデルは複数の変数間の分散変動性に着目する新しいアプローチであり、興味深い。

次に制限的従属変数を含むデータの統計的分析であるが、いくつかのタイプが存在するが、よく知られているのは、従属変数が0,1,2,3,4というような離散的値をとるという制限のある場合のProbit, Logitモデルである。たとえば、住宅購入支出額の分析を行う場合、従属変数は住宅を保有している(1)、保有していない(0)という二値変数をとる。他の制限的従属変数の分析としては、自宅購入支出予定額の分析を行う場合に、自宅保有に関心のある家計とそうでない家計の両方のデータを対象とする閾値モデル、自宅保有に関心のある家計のみのデータを対象とする切斷モデルなどがある。また様々な回帰分析を行う上で興味深い制限的従属変数の問題として、サンプルセレクションバイアスの問題がある。これはサンプルの選択においてなんらかの理由により選択が行われており、それと関連する要因が回帰分析において影響を持ちうる場合のことをいう。このような場合、回帰分析の結果は大きな偏りを持つ可能性がある。

● 想定パートナー

金融関係、制限的従属変数問題に関心のある自治体、企業関係

● 応用分野

オプションプライシング、倒産確率推定、社債格付け、需要分析、労働分析、政策効果分析