

ふりがな           すぎた   かつひろ

氏名               杉田 勝弘

## 1. 学歴

---

1996年 10月 米コロンビア大学卒業  
2004年 7月 英ウォーリック大学経済学博士

## 2. 職歴・研究歴

---

2001年 10月 英シティ大学ビジネススクール研究員  
2004年 4月 一橋大学経済学部専任講師

## 3. 学内教育活動

---

### A. 担当講義名

#### (a) 学部学生向け

基礎計量経済学

#### (b) 大学院

中級計量経済学

### C. 講義およびゼミナールの指導方針

基礎計量経済学は学部 2 年生が対象なので、テキストを中心に厳密な理論より実践的にデータ分析できるよう指導する。中級計量経済学は基礎計量経済学を履修したもの、もしくは大学院生で計量経済学を余り勉強しなかった者を対象とするので、それ程レベルは高くはないが、予習、復習を前提とし比較的厳しくするつもりである。

## 4. 主な研究テーマ

---

時系列分析, 主にベイズ法を使った非線形モデルの分析及び応用。

## 5. 研究活動

---

### A. 業績

#### (b) 論文 ( 査読つき論文には\* )

"Bayesian Cointegration Analysis" , 2001, *Warwick Research Paper*, No. 591.

"Testing for Cointegration Rank Using Bayes Factors" , 2002, *Warwick Research Paper*, No. 654.

"Bayesian Analysis of Cointegrated Vector Autoregressive Models" , Ph.D. Thesis, University of Warwick, May, 2004.

"Time Series Analysis of the Expectations Hypothesis for the Japanese Term Structure of Interest Rates in the Presence of Multiple Structural Breaks" , *Hitotsubashi Discussion Papers*, 2006-15.

"Bayesian Analysis of Dynamic Multivariate Models with Multiple Structural Breaks" , *Hitotsubashi Discussion Papers*, 2006-14.

"Bayesian Analysis of Markov Switching Vector Error Correction Model" , *Hitotsubashi Discussion Papers*, 2006-13

\* "Bayesian Analysis of a Markov Switching Temporal Cointegration Model" , *Japan and the World Economy*, forthcoming.