

2018年度（第26回）関西計量経済学研究会プログラム

日程：2019年1月5日（土）－2019年1月6日（日）

場所：宮崎公立大学 研究講義棟 501 講義室

共催：日本統計学会「計量経済・計量ファイナンス分科会」

日本学術会議 数量的経済・政策分析分科会

1月5日（土）

10:30 - 12:00 セッション1（優秀報告賞選考セッション）

座長：西山慶彦（京都大学）

1. 蔣佩芸（一橋大学）

“Monitoring Parameter Change in Models with a Trend”

共著：黒住英司

2. 石原卓弥（東京大学）

“Partial Identification of Discrete Instrumental Variable Models using Shape Restrictions”

3. 米倉頌人（University College London）

“Forward only particle smoothing for partially observed diffusions and jump diffusions: with applications to parameter estimation”

共著：Alexandros Beskos, Sumeetpal S. Singh

12:00 - 13:00 昼食

13:00 - 14:30 セッション2

座長：稲田光朗（宮崎公立大学）

4. 山崎大輔（九州大学）

“Improved Confidence Sets for the Date of a Structural Break”

5. 山田宏（広島大学）

“Whittaker-Henderson Graduation, Discrete Cosine Transform and Graph Spectral Filtering”

6. 栗田高光（福岡大学）

“Partial Cointegrated Vector Autoregressive Models with Structural Breaks in Deterministic Terms”

共著：Bent Nielsen

14:30 - 14:40 休憩

14:40 - 16:10 セッション3

座長：末石直也（神戸大学）

7. 中西勇人（神奈川大学）

“Semi-parametric Estimation of Exchangeable Distribution when Highest or Lowest, and Another Order-statistics are Observable: an Application to First Price Auction”

8. 星野匡郎（早稲田大学）

“Treatment Effect Models with Strategic Interaction in Treatment Decisions”

共著：柳貴英

9. 荒井洋一（早稲田大学）

“Testing Identifying Assumptions in Fuzzy Regression Discontinuity Designs”

共著：Yu-Chin Hsu, Toru Kitagawa, Ismael Mourifie, Yuanyuan Wan

16:10-16:20 休憩

16:20-17:20 セッション4

座長：大屋幸輔（大阪大学）

10. 木下亮（東京経済大学）

“Intertemporal CAPM and Horizon-specific Risk Prices in the Japanese Stock Markets”

11. 小塚匡文（流通科学大学）

“土地資産を考慮した C-CAPM の有効性およびパラメータ安定性の検証”

共著：森澤龍也

18:00 - 20:00 懇親会 & 優秀報告賞表彰式

於 ホテルメリージュ

1月6日（日）

10:30 - 12:00 セッション5

座長：柳貴英（京都大学）

12. 末石直也（神戸大学）

“Semiparametric Efficiency Bound for Moment Restriction Models with Time Series Observations”

13. 奥井亮（NYU Shanghai）

“Confidence Set for Group Membership”

共著：Andreas Dzemski

14. 新谷元嗣（東京大学）

“Frequency-wise Causality Analysis in Infinite Order Vector Autoregressive Processes”

共著：木下亮, 大屋幸輔