

(2023年1月6日版)

## 2022年度（第30回）関西計量経済学研究会プログラム

日時：2023年1月7日（土）、8日（日）

場所：大阪大学・豊中キャンパス 法経講義棟・1番講義室

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  
大阪大学大学院経済学研究科

オンライン参加の場合は、<http://stat.econ.osaka-u.ac.jp/~kkkk/>からどうぞ。

### （注意事項：1/2 追記）

- ・発表者は**25分報告**、**5分質疑応答**でお願いします（25分でベル1回、30分でベル2回）。
- ・教室の質問者は必ず**マイク**を使ってください（オンライン参加者に聞こえるように）。

-----2023/01/07-----

### 9:29 【オープニング】

### 9:30-10:30 【セッション1】

座長：谷崎 久志（大阪大）

- ・ Benjamin Michel Claude Poignard <sup>ポイニヤル</sup>（大阪大）

“Sparse M-estimators in semi-parametric copula models” (with Jean-David Fermanian, ENSAE ParisTech and CREST)

- ・ 柳 貴英（京都大）

“Randomization Tests for the Specification of Interference Structure” (with Tadao Hoshino, Waseda University)

### 10:40-12:10 【セッション2：優秀報告賞セッション】

座長：末石 直也（神戸大）

- ・ 今井 竣祐 <sup>いまい しゅんすけ</sup>（京都大）

“Fully Data-driven Normalized and Exponentiated Kernel Density Estimator with Hyvarinen Score” (with ラトガス大・郡山拓也，講談社・米倉頌人，東京大・菅澤翔之助，京都大・西山慶彦)

- ・ 金 建偉 <sup>きん けんい</sup>（横浜国立大）

“Unit root tests with initial values and a concise method for computing powers” (with 人見 光太郎，永井 圭二，西山 慶彦，陶 俊帆)

- ・ 阿部 達也 <sup>あべ たつや</sup>（早稲田大）

“Welfare Effects of Fuel Tax and Feebate Policies in the Japanese New Car Market”

12:10-13:00 【昼食：生協食堂（図書館下食堂）】 ←学外の方は5%加算されます

### 13:00-14:30 【セッション3：優秀報告賞セッション】

座長：奥井 亮（東京大）

- ・ 田柳 俊和（一橋大） → オンライン報告

“Change point estimator with the weighted objective function when estimating breaks one at a time”  
(with 一橋大・黒住英司)

- ・ 蔣 佩芸（東京都立大）

“Testing for structural change in heterogeneous panels using common correlated effects estimators”

- ・ 澤谷 一磨（東京大）

“Estimation of Moderately High-Dimensional Single Index Models with a Monotone Link”

### 14:40-15:40 【セッション4：優秀報告賞セッション】

座長：大屋 幸輔（大阪大）

- ・ 西 幹仁（一橋大）

“Testing for Coefficient Randomness in Local-to-Unity Autoregressions”

- ・ 唐 越之（横浜国立大） → オンライン報告

“Criticality tests for branching process with immigration” (with Keiji Nagai)

### 15:50-16:50 【セッション5：日本学術会議数量的経済・政策分析分科会 企画セッション】

座長：福重 元嗣（大阪大）

- ・ 刈屋 武昭（名古屋商科大） → オンライン報告

“A Modelling Framework for Regression with Collinearity” (with 東京大・倉田博史，慶應義塾大・林高樹)

- ・ 縄田 和満（一橋大）

“Risk factors affecting cerebrovascular dis-ease : Potential side effects of antihypertensive medications”

### 17:00-18:00 【セッション6】

座長：山田 宏（広島大）

- ・ 田中 久稔（早稲田大）

“Dual Flatness of Single-Index Regression Models”

- ・ 蛭川 雅之（龍谷大）

“Nonparametric Threshold Detection for Cost Distributions” (with Benedikt Funke, TH Köln)

### 18:00-18:10 【優秀報告賞表彰式】

### 18:30-20:30 【計量経済学の最新の研究動向に関する意見交換会】

- ・ 「[がんこ 池田石橋苑](#)」(会場から徒歩 10～15 分くらい)

〒563-0032 大阪府池田市石橋 3 丁目 3 番 18 (Tel: 072-760-3888)

-----2023/01/08-----

**10:00-11:00 【セッション7】 ← 開始時間変更**

座長：難波 明生（神戸大）

- ・山田 宏（広島大）

“Nonnegative Definite Matrix Penalized Filtering with Quantile Regression Loss Function” (with Ruoyi Bao)

- ・坂口 翔政（東京大）

“Constrained Classification and Policy Learning”

**11:10-12:10 【セッション8】**

座長：蛭川 雅之（龍谷大）

- ・栗田 高光（京都産業大）

“The econometric modelling of cryptocurrency prices from a policy-oriented perspective” (with Jennifer L. Castle, University of Oxford)

- ・末石 直也（神戸大）

“A misuse of specification tests”

**12:10-13:30 【昼食】（日曜日は大学内の食堂は開いていません。**

**各自、予め弁当を用意するか駅の方へ食べに行くかをお願いします。）**

**13:30-15:30 【セッション9】**

座長：竹内 恵行（大阪大）

- ・奥井 亮（東京大）

“Recovering latent linkage structures and spillover effects with structural breaks in panel data models”

- ・木下 亮（東京経済大）

「株式市場における鉱工業生産指数のリスクプレミアムの推定」

- ・澤田 真行（一橋大）

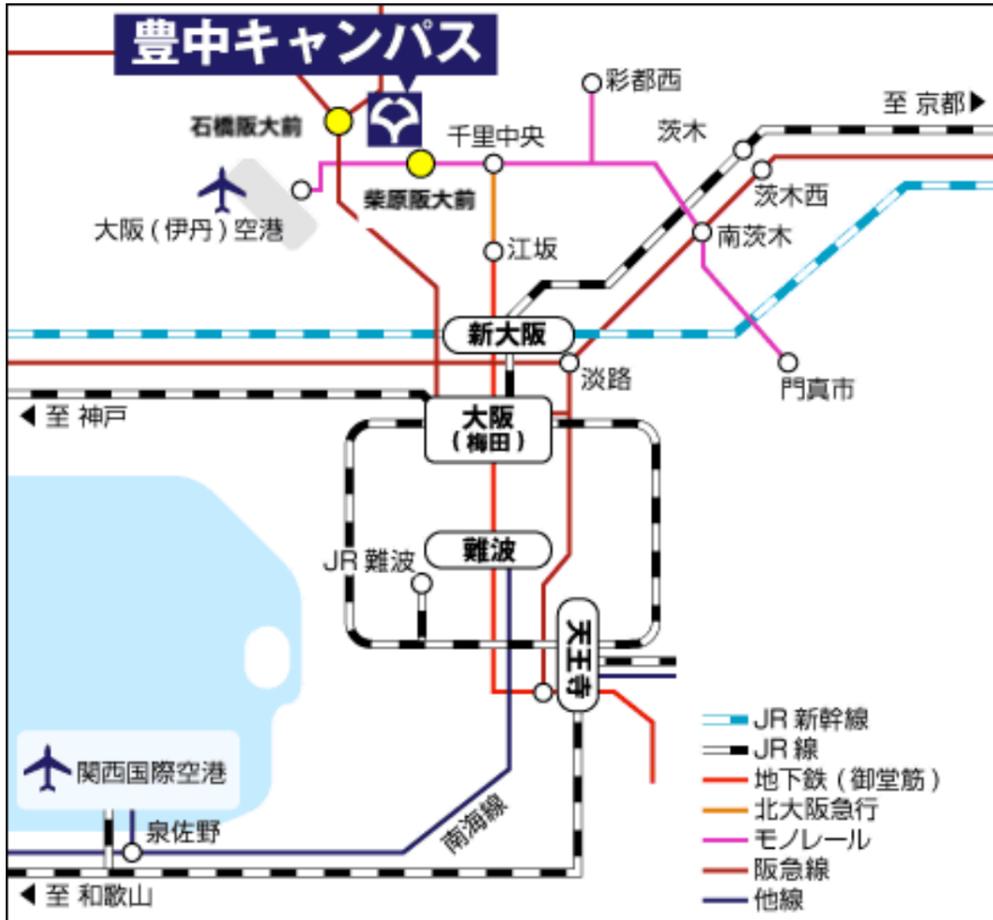
“Finite-sample optimal estimation for binary-outcome regression discontinuity designs” (with Takuya Ishihara, 東北大学 and Kohei Yata, ウィスコンシン大)

- ・加藤 隆太（広島大） → オンライン報告

“Extremal Quantile Regression under Multi-way Clustering” (with Harold D. Chiang and Yuya Sasaki)

# アクセス

## 《主要ターミナルからのアクセス》



● 駅から経済学研究科 / 経済学部まで 柴原阪大前駅から徒歩約10分～15分。石橋阪大前駅から徒歩約15分～25分。

- 関西国際空港から (3 方法あります)
  - (1) JR線で大塚駅へ
    - 地下鉄御堂筋で千里中央駅乗り換え
    - モノレールで柴原阪大前駅下車。
    - (約2時間)
  - (2) 南海線で難波駅へ
    - 地下鉄御堂筋で千里中央駅乗り換え
    - モノレールで柴原阪大前駅下車。
    - (約2時間)
  - (3) 空港バスで大塚(伊丹)空港へ
    - モノレールで柴原阪大前駅下車。
    - (約2時間30分)

- 新大阪駅から 地下鉄御堂筋で千里中央駅乗り換え
  - モノレールで柴原阪大前駅下車。
  - (約1時間)
- 大阪空港から モノレールで柴原阪大前駅へ。
- (約30分)
- モノレールから 柴原阪大前駅下車。 徒歩約10～15分。

## 《キャンパスマップと会場》

