## 関西計量経済学研究会 2010 年度研究発表会 プログラム

共 催:日本学術会議「数量的経済・政策分析分科会」 日本統計学会「計量経済・計量ファイナンス分科会」

日 時: 2011年1月8日(土) 10:00~18:45

1月9日(日) 9:15~13:00

場 所: 大阪大学中之島センター 7階講義室2

(http://www.onc.osaka-u.ac.jp/others/map/index.php)

## 1月8日(土)

10:00~12:00 セッション1:座長 福重元嗣(大阪大学)

小林弦矢(神戸大学大学院経営学研究科 D1)\*, 古澄英男(神戸大学経営学研究科)

"Generalized Multiple-Point Algorithms for Approximate Bayesian Computation"

田中晋矢(一橋大学大学院経済学研究科 D3)\*, 黒住英司(一橋大学大学院経済学研究科)

"Investigating Finite Sample Properties of Estimators for Approximate Factor Model When N Is Small"

稲田光朗(京都大学大学院経済学研究科 D2)\*, 手島健介 (Instituto Tecnológico Autónomo de México)

"The Impact of FDI on Industry Productivity in China: Evidence from a Regulation Change"

木下 亮 (大阪大学大学院経済学研究科 M2)

"Learning process in markets: Sequential trading with Bayesian learning"

12:00~13:30 昼食

13:30~15:00 セッション 2 (英語セッション): 座長 西山慶彦 (京都大学)

Chia-Lin Chang (National Chung Hsing University, Taiwan)\*, Chen, S.P., and M. McAleer (Erasmus University Rotterdam)

"Globalization and Knowledge Spillover: International Direct Investment, Exports and Patents"

McAleer, Micheal (Erasmus University Rotterdam)\*, Jiménez-Martin, J.A. (Universidad Complutense, Spain), Amaral, T.P. (Universidad Complutense)

"GFC-Robust Risk Management Strategies under the Basel Accord"

Jiménez-Martin, J.A. (Universidad Complutense)

"International evidence on GFC-robust forecasts for risk management under the Basel Accord"

 $15:00\sim15:30$  Coffee Break

15:30~16:30 セッション3 (日本学術会議セッション): 座長 大屋幸輔 (大阪大学)

Lee, Yoon-Jin (Indiana University), 奥井 亮 (京都大学経済研究所)\*, 新谷元嗣 (Vanderbilt University)

"Asymptotic Inference for Dynamic Panel AR(∞) Processes"

16:30~16:45 Short Break

16:45~18:45 セッション4:座長 黒住英司(一橋大学)

岩倉相雄(京都大学大学院経済学研究科 M2)\*, 奥井亮(京都大学経済研究所)

"Efficient Estimation of Autocovariances for Panel Data with Individual Effects under Cross Section and Time Series Asymptotics"

北沢良継 (九州産業大学経済学部)

"A hyperbolic transformation for a fixed effects logit model"

縄田和満 (東京大学大学院工学系研究科)\*, 川渕孝一 (東京医科歯科大学大学院)

「多数の病院における白内障手術の在院日数の分析について-2006 年度診療報酬改定に伴う DPC見直しの影響の評価-」

吉村有博(京都大学大学院経済学研究科 M2)

"Identification and Estimation of Simultaneous Discrete Games: A Survey"

19:00~21:00 懇親会@「ワインウエアハウス堂島店」 (大阪市福島区福島 1-1-48 THE TOWER OSAKA 1F)

1月9日(日)

9:15~11:15 セッション5:座長 谷崎久志(神戸大学)

赤司健太郎 (統計数理研究所)\*, 川崎能典 (統計数理研究所)

「2項モデルの予測によるリスク総額最小化」

黒住英司 (一橋大学大学院経済学研究科)\*, 青野幸平(立命館大学経営学部)

"Estimation and Inference in Predictive Regressions"

劉 慶豊 (小樽商科大学商学部)

"Model Averaging for High Dimension Data"

末石直也(京都大学大学院経済学研究科)

"Information Criteria for Moment Restriction Models"

11:15~11:30 Short Break

11:30~13:00 セッション6:座長 末石直也(京都大学)

矢部竜太 (一橋大学大学院経済学研究科 D1)

"Moderate deviation from a unit root in MA(1)"

植松良公 (一橋大学大学院経済学研究科 M2)

"Regression with a Slowly Varying Regressor in the Presence of a Unit Root in Autoregressive Errors"

徐 海峰 (神戸大学大学院経済学研究科 M2)

"Risk performance of a pre-test ridge regression estimator under a multivariate t distribution error term when each individual regression coefficient is estimated"

注記: 報告時間は一報告あたり 30 分 (討論を含む)。ただしセッション 3 は 60 分。 \*印は報告者を表している。