

# 2012 年度関西計量経済学研究会

共催：日本学術会議「数量的経済・政策分析分科会」

Hitotsubashi Conference on Econometrics 2013

(一橋大学グローバル COE プログラム「社会科学の高度統計・実証分析拠点構築」)

2013 年 1 月 12 日, 13 日

一橋大学佐野書院

## プログラム

### 1 月 12 日(土)

開会(9:30)

#### Session I (9:30-11:00) 座長：黒住 英司 (一橋大学)

➤ 菅原 慎矢 (東京大学・学振 PD)

Analysis for Job Duration of Japanese Elder Care Workers Using a Moment Inequality Model

➤ 松本 章邦 (東京大学)

Safety and Health of Contract Workers in Japanese Regulated Industry

➤ 小西 葉子 (経済産業研究所)

Decomposition of Supply and Demand Shock in Production Function Using Current Survey of Production

Break (11:00-11:15)

#### Session II (11:15-12:15) 座長：小西 葉子 (経済産業研究所)

➤ 星野 匡郎 (東京工業大学・学振 PD)

Estimation of Semiparametric Binary Choice Models with Missing Response Data

➤ 高梨 耕作 (慶應義塾大学・大学院)

Cp Criteion for the Quantile Regression

Lunch (12:15-13:50)

特別セッション (13:50-15:50) 座長：大屋 幸輔 (大阪大学)

『Recent Development in Quatile Regressions』

日本学術会議 数量的経済・政策分析分科会主催・一橋大学グローバル COE プログラム共催

➤ 本田 敏雄 (一橋大学)

Nonparametric Quantile Estimation for Time Series

➤ 岡 達志 (シンガポール国立大学)

The Cross-Quantilogram and Testing Directional Predictability between Time Series

➤ 加藤 賢悟 (広島大学)

Estimation in Functional Linear Quantile Regression

Break (15:50-16:10)

Session III (16:10-18:10) 座長：西山 慶彦 (京都大学)

➤ 王 文傑 (京都大学・大学院)

Bootstrap Inference for Linear IV Model with Many Weak Instruments

➤ 岩澤 政宗 (京都大学・大学院)

A Specification Test for Multinomial Choice Models

➤ 柳 貴英 (京都大学・大学院)

Local Average Structural Derivatives with Truncation

➤ 赤司 健太郎 (学習院大学)

A Feasible Alternative To Weighted MLE For Endogenous Sampling

懇親会 (18:20-20:20) 一橋大学佐野書院

1月13日(日)

Session I (9:30-11:00) 座長：山本 庸平 (一橋大学)

➤ 王 成揚 (京都大学・大学院)

Optimal Volatility Forecasting Model for the CSI 300 Index : Using High Frequency Data

➤ 木下 亮 (大阪大学・大学院)

Asset Allocation under Higher Moments with the GARCH Filter

➤ 石田 功 (大阪大学)

On the Moving Quantile Effects in (Financial) Time Series

Break (11:00-11:15)

**Session II (11:15-12:15) 座長：石田 功 (大阪大学)**

- 小林 正人 (横浜国立大学)

Testing for the Single Risk against Dependent Competing Risk Duration Model under the Proportional Hazard Assumption

- 刈屋 武昭 (明治大学)

Measuring Credit Risk of Individual Corporate Bonds and Deriving Term Structures of Default Probabilities

Lunch (12:15-13:20)

**Session III (13:20-15:50) 座長：小林 正人 (横浜国立大学)**

- 末石 直也 (京都大学)

Bayesian Empirical Likelihood for Moment Inequality Models

- 井上 篤 (ノースカロライナ州立大学)

A Pseudo Panel Approach to Rational Addiction Models

- 山本 庸平 (一橋大学)

Identifying Stable and Unstable Factor Loadings in Dynamic Factor Models

- 山崎 大輔 (一橋大学・大学院)

Testing for Parameter Constancy in the Time-Series Direction in Fixed-Effect Panel Data Models

- 中西 勇人 (東京工業大学・大学院)

Sieve Maximum Rank Correlation Estimator of Transformation Models with Semi-Varying Coefficients

閉会(15:50)