

2014 年度 (第 22 回) 関西計量経済学研究会・プログラム

- ・ **開催日** : 2015 年 1 月 10 日(土), 11 日(日)
- ・ **会場** : 大阪大学・豊中キャンパス・法経講義棟・1 階・第 1 講義室
宙 SORA (豊中キャンパス内, 1 月 10 日 18:00~20:30)
- ・ **共催** :
 - 大阪大学大学院経済学研究科 (寄附金 : 50 周年記念事業)
 - 日本統計学会「計量経済・計量ファイナンス分科会」
 - 日本学術振興会・科学研究費補助金・基盤研究(A)(一般) #23243038

● 2015 年 1 月 10 日(土)

【セッション 1】 (10:00-12:00)

座長 : 谷崎 久志 (大阪大学大学院経済学研究科)

- ・ 池田 祐樹 (東京大学経済学研究科)

「ファクターモデルをもちいた高次元分散共分散行列の推定とその応用」

- ・ 矢部 竜太 (日本学術振興会特別研究員 PD@一橋大学)

“Semiparametric least squares estimation of the single-Index model with nonstationary regressors”

- ・ 茂木 快治 (早稲田大学政治経済学術院)

“Sluggish Private Investment in Japan's Lost Decade: Mixed Frequency Vector Autoregression Approach” (貞廣彰と共著)

- ・ 北沢 良継 (九州産業大学経済学部)

“Root-N consistent estimations of time dummies for the dynamic fixed effects logit models: Monte Carlo illustrations”

【昼休み】

【セッション 2】 (13:00-14:30)

座長：福重 元嗣 (大阪大学大学院経済学研究科)

・ 田村 肇 (筑波大学図書館情報メディア研究科)

「産業連関表の粗視化 (質的化) の理由と問題点—ネットワーク分析の観点から—」

・ 宇南山 卓 (財務総合政策研究所&一橋大学経済研究所)

「保育所整備の政策効果」

・ 近藤 恵介 (経済産業研究所 RIETI)

「高失業率に対する人口移動の反応：日本の市区町村データを用いた空間計量経済分析」

【セッション 3】 (14:40-16:10)

日本学術会議 経済学委員会 数量的経済・政策分析分科会 企画セッション

座長：西山 慶彦 (京都大学経済研究所)

・ 黒住 英司 (一橋大学経済学研究科)

“Confidence Set for the Break Date Based on an Optimal Test”

・ 新谷 元嗣 (東京大学先端科学技術研究センター)

“Testing for Flexible Nonlinear Trends with an Integrated or Stationary Noise Component”

・ 末石 直也 (京都大学経済学研究科)

“Penalized empirical likelihood estimation and tuning parameter selection in misspecified models”

【セッション 4】 (16:20-17:50)

座長：新谷 元嗣 (東京大学先端科学技術研究センター)

・ 今泉 允聡 (東京大学経済学研究科)

「再生核理論によるセミパラメトリック効率推定」

・ 山本 庸平 (一橋大学経済学研究科)

“A Modified Confidence Set for the Structural Break Date in Linear Regression Models”

・ 柳 貴英 (京都大学経済学研究科)

“The Effect of Measurement Error in the Sharp Regression Discontinuity Design”

【計量経済学の最新の研究動向に関する会議】 (18:00-20:30)

場所：宙 SORA (豊中キャンパス内)

● 2015年1月11日(日)

【セッション 5】 (9:00-10:30)

座長: 大屋 幸輔 (大阪大学大学院経済学研究科)

・ 陳 景輝 (横浜国立大学経済学研究科)

“Testing for Perfectly Correlated Volatility Changes in Bivariate Stochastic Volatility Model”

・ 杉浦 航 (慶應義塾大学経済学研究科)

「高頻度データを用いた約定予測に関する試論」 (マクリン謙一郎・中妻照雄と共著)

・ 久田 貴紀 (大阪大学経済学研究科)

“Differences in Risk Tolerance and Asset Allocation by race/ethnic in the United States”

【セッション 6】 (10:40-12:10)

座長: 宇南山 卓 (財務総合政策研究所&一橋大学経済研究所)

・ 木下 信 (龍谷大学経済学部)

「家計によるエネルギー源選択のコンジョイント分析—原子力と再生可能エネルギーに対する選好に注目して—」

・ 中西 勇人 (日本学術振興会特別研究員 DC@東京工業大学)

“Economic Valuation of Environmental Quality Using Property Auctions Data: A Structural Estimation Approach”

・ 永嶋 弘樹 (慶應義塾大学経済学研究科)

「日本の都道府県別景気指数のベイズ時空間推定」 (中妻照雄と共著)

【昼休み】

【セッション 7】 (13:30-14:30)

座長: 黒住 英司 (一橋大学経済学研究科)

・ 増田 淳矢 (中京大学経済学部)

「クロスセクション間に相関を許容した SUR モデルのパネル単位根検定」

・ 坂口 翔政 (京都大学大学院経済学研究科)

“Estimation of Average Treatment Effects Using Panel Data with Fixed Effects”

【セッション 8】 (14:40-16:10)

座長：竹内 恵行 (大阪大学大学院経済学研究科)

・大鋸 崇 (千葉大学法政経済学部)

「東日本大震災が証券市場に与えた影響」

・北村 友宏 (神戸大学経済学研究科)

「資本費補助が鉄道事業者の効率性に与える影響 —内生性を考慮した確率的フロンティア分析—」

・王 文杰 (京都大学大学院経済学研究科)

“A Field Experiment on Dynamic Electricity Pricing in Los Alamos: Opt-in Versus Opt-out” (依田高典と共著)

*** 持ち時間：一人当たり 30 分 (報告 20~25 分)**

