2016年度(第24回)関西計量経済学研究会プログラム

・日程:　2017年1月7日(土), 8日(日)
・場所：　広島大学東千田キャンパス・東千田未来創生センター2F
・懇親会：料亭久里川 (2017年1月7日(土): 19：00～21:00)
・共催：　日本学術会議、数量的経済・政策分科会
日本統計学会「計量経済・計量ファイナンス分科会」
日本学術振興会・科学研究費補助金・基盤研究(B)(一般)
#16H03606「高次元データの統計分析」
広島大学統計科学研究拠点

● 2017年1月7日(土)

【セッション1(優秀報告賞セッション)】 (10:00-10:50)
座長： 西山慶彦　(京都大学)
・堀江　哲史　(一橋大学)
Testing for Speculative Bubbles in Large-Dimensional Financial Panel Data Sets (with 山本 庸平)
・石原　卓弥　(東京大学)
Partial Identification of Nonseparable Models with Discrete Instruments

【セッション2(優秀報告賞セッション)】 (11:00-11:50)
座長：谷崎久志　(大阪大学)
・金　燕春　(京都大学)
Testing for Overconfidence Statistically: A Moment Inequality Approach (with 奥井亮)
・茂木　快治　(神戸大学)
Testing for Weak Form Efficiency of Stock Markets (with Jonathan B. Hill)

【昼休み】 (11:50-13:00)

【セッション3(優秀報告賞セッション)】 (13:00-14:15)
座長：黒住英司(一橋大学)
・中北　誠　(慶應義塾大学)
Bayesian Analysis of Intraday Stochastic Volatility Models with Leverage and Skew Heavy-Tailed Error in High-Frequency Commodity Market (with 中妻照雄)
・中西　勇人　(京都大学)
Can economic structural model explain behavior change? Evidence from the Great East Japan earthquake (with 岩澤政宗)

・坂口　翔政　(京都大学)
Estimation of Time-varying Average Treatment Effects Using Panel Data when Unobserved Fixed Effects Affect Potential Outcomes Differently

【セッション4(優秀報告賞セッション)】 (14:25-15:40)
座長：末石直也　(神戸大学)
・鳥谷部　智規　(慶應義塾大学)
Bayesian modeling of autocorrelation and intraday seasonality in financial durations (with 中妻照雄)
・山崎　大輔　(京都大学)
An Improved Test for Cross-Section Independence in Panel Data Models with Serially Correlated Errors
・柳　貴英　(一橋大学)
Inference on Local Average Treatment Effects for Misclassified Treatment

【セッション5(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)】 (15:50-17:10)
座長：西埜晴久　(広島大学)
・松田 安昌　(東北大学)
Introduction of CARMA Random Fields: Spatial Extension of Time Series CARMA Models
・矢島 美寛　(東北大学)
On Estimation of Intrinsic Stationary Random Fields

【セッション6】 (17:20-18:35)
座長：山本庸平　(一橋大学)
・栗田　高光　(福岡大学)
Testing parameter constancy in I(2) cointegrated VAR models
・山田　宏　(広島大学)
Quantile Hodrick-Prescott Filtering
・片山　直也　(関西大学)
Testing for Bubbles by an Outlier Robust Unit Root Test

【懇親会】 (19:00-21:00)

● 2017年1月8日(日)

【セッション7】 (9:30-10:45)
座長： 福重元嗣
・北沢良継 (九州産業大学)
DFEL-RTN, a set of TSP codes for the root-N consistent estimations of the dynamic fixed effects logit models
・劉 慶豊 (小樽商科大学)
Model Selection and Model Averaging for Nonlinear Regression Models (with Qingsong Yao、Guoqing Zhao)
・松井 宗也 (南山大学)
The extremogram and the cross-extremogram for a bivariate GARCH(1,1) process の続編

【セッション8】 (10:55-11:45)
座長：早川和彦(広島大学)
・小塚 匡文 (流通科学大学)
Public Capital and Asset Prices: Time series Evidence from Japan (with 平賀一希、宮崎智視)
・田村 肇 (筑波大学)
質的産業連関表の粗視化とネットワーク中心性の頑健性 ～ RAS法を使ったシミュレーションによる確認 ～

＊持ち時間: 一人当たり25分 (ただし、企画セッション(セッション5)は40分)