

2017年度（第25回）関西計量経済学研究会プログラム

日程：2018年1月6日（土）

場所：神戸大学六甲台第1キャンパス アカデミア館501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

【セッション1（優秀報告賞セッション）】10：30－12：00

座長：難波明生（神戸大学）

1. 佐藤宇樹（東北大学）

“Spatiotemporal Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Model”

松田安昌（東北大学）と共著

2. 劉焯（京都大学）

“Stationarity of Autoregressive Processes with Endogenous Regime Switching and Asymptotic Properties of the Maximum Likelihood Estimator”

3. 大田浩史（東京大学）

“Semi-parametric Estimation of Index Coefficients in Modal Regression: Sample Splitting Approach”

【昼休み】12：00－13：00

【セッション2（優秀報告賞セッション）】13：00－14：00

座長：西山慶彦（京都大学）

4. 北村友宏（神戸大学）

“Returns to Density of Regional Railroad Companies in Japan: Hedonic Cost Function Approach”

5. 栗栖大輔（東京大学）

“Bootstrap confidence bounds for spectral estimation of Levy densities under high-frequency observations”

加藤賢悟（東京大学）と共著

【セッション3（優秀報告賞セッション）】14：10－15：40

座長：大屋幸輔（大阪大学）

6. 米倉頌人（University College London）

“Asymptotic Analysis of BIC and AIC for Hidden Markov Models”

Alexandros Besko（UCL）, Sumeetpal Singh（University of Cambridge）と共著

7. 堀江哲史（一橋大学）

“Skewness Tests for the Common Factor Model”

8. 石原卓弥（東京大学）

“Panel Data Quantile Regression for Treatment Effect Models”

【セッション4（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）】15：50－16：50

座長：茂木快治（神戸大学）

9. 黒住英司（一橋大学）

“Confidence Sets for the Date of a Mean Shift at the End of a Sample”

10. 山本庸平（一橋大学）

“Identifying Factor-Augmented Vector Autoregression Models by a Change in the Shock Variances”

【セッション5】17：00－18：30

座長：早川和彦（広島大学）

11. 松井宗也（南山大学）

“Applications of Distance Correlation to Time Series”

Richard A. Davis, Thomas Mikosch, Phyllis Wan と共著

12. 柳貴英（一橋大学）

“Kernel Estimation for Panel Data with Heterogeneous Dynamics”

奥井亮（NYU Shanghai）と共著

13. 福井紳也（大阪産業経済リサーチセンター）

「本社機能の立地・移転について：「企業活動基本調査」を用いた実証分析」
安田公治（大阪産業経済リサーチセンター）との共著

【懇親会】18：40－20：40（於：アカデミア館1階生協食堂）