

## 2019 年度(第 27 回)関西計量経済学研究会プログラム

日時: 2020 年 1 月 11 日(土) - 2020 年 1 月 12 日(日)

場所: 一橋大学 国立東キャンパス 第 3 研究館 3F 研究会議室

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

### 1 月 11 日(土)

**09:40-10:55【セッション 1】**座長: 黒住英司(一橋大学)

・本田敏雄(一橋大学)

The de-biased group Lasso estimation for varying coefficient models

・刈屋武昭(城西国際大学)

Measuring credit risk of individual corporate bonds and deriving term structure of default probabilities

・渡部敏明(一橋大学)

High-frequency stochastic volatility models

**11:05-12:20【セッション 2】**座長: 末石直也(神戸大学)

・田中久稔(早稲田大学)

On a differentiation formula of conditional expectations

・永井圭二(横浜国立大学)

The relationship between Dickey-Fuller test and sequential unit root test

・西尾敦(明治学院大学)

A note on the Monte Carlo estimation of the Dickey-Fuller distributions

**12:20-13:40 昼食**

**13:40-14:55【セッション 3: 優秀報告賞セッション】**座長: 西山慶彦(京都大学)

・米倉頌人(University of College London)

Bayesian model selection via Hamiltonian Monte Carlo on high dimensional spaces:  
Applications to diffusion models driven by fractional noise

・高梨耕作(理化学研究所)

Predictive properties of forecast combination, ensemble methods, and Bayesian predictive synthesis

・加葉田大志朗(東京大学)

Variable selection in double/debiased machine learning for causal inference: An outcome-adaptive Lasso approach

**15:05-15:55【セッション 4:優秀報告賞セッション】座長:谷崎久志(大阪大学)**

・伏島光毅(東京大学)

Multi-valued treatment effects with unobserved heterogeneity: Identification with closed-form solutions

・陶俊帆(京都大学)

Sequential unit root test for AR(p) processes

**16:05-17:45【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】座長:福重元嗣(大阪大学)**

・石原卓弥(東京大学)

Meta-analysis for treatment choice

・柳貴英(京都大学)

Estimating marginal treatment effects under unobserved group heterogeneity

・栗田高光(福岡大学)

Johansen test with Fourier-type smooth non-linear trends in cointegrating relations

・国友直人(明治大学)

A Robust-filtering method for noisy non-stationary time series with an application to Japanese macro-consumption

**18:00-20:00【懇親会:一橋大学東生協 2F】**

**1月12日(日)**

**09:40-10:55【セッション 6】座長:山本庸平(一橋大学)**

・菅原慎矢(東京理科大学)

A panel VAR analysis for dynamics of health and expenditures for multiple long-term care services

・縄田和満(東京大学)

大規模検診・レセプトデータを使った医療分析:ACC・AHA の高血圧新基準の評価

・末石直也(神戸大学)

A Large sample justification for the Bayesian empirical likelihood

11:05-12:45【セッション 7】座長：大屋幸輔（大阪大学）

・木下亮（東京経済大学）

Asymptotic bias of the two-pass regressions for risk premium estimation

・松井宗也（南山大学）

Characterization of the tail behavior of a class of BEKK processes: A stochastic recurrence equation approach

・山崎大輔（九州大学）

Modified sequential procedure to estimate the number of breaks in trend

・片山直也（関西大学）

A New test for additive outliers in non-stationary processes using the Box-Cox transformation

※発表は一人 25 分をお願いします（質疑応答を含む）。