

2023 年度(第 31 回)関西計量経済学研究会プログラム

- ・ 日程： 2024 年 1 月 6 日(土), 7 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 M303 教室
<https://www.hiroshima-u.ac.jp/access/sendai>
- ・ 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) #20H01484
「ファクターモデルと罰則化法を用いた時系列・パネルデータの計量分析:理論と応用」
広島大学経済学会

- (注意事項) ・発表者は 20 分報告, 5 分質疑応答をお願いします。
・教室の質問者は必ずマイクを使ってください(オンライン参加者に聞こえるように)。

● 2024 年 1 月 6 日(土)

【セッション 1】 (9:25-10:40)

座長： 早川 和彦 (広島大学)

- ・ 木下 亮 (東京経済大学)
"A Demonstration of the Distinction between Causality and Predictability"
- ・ 山本 庸平 (一橋大学)
"Testing and Quantifying Economic Resilience"
- ・ 川崎 能典 (統計数理研究所)
"Statistical Modeling of Financial Data with Skew-Symmetric Error Distributions"
(with 地道正行, 宮本大輔, 阪智香, 永田修一)

【セッション 2】 (10:45-12:00)

座長： 黒住 英司 (一橋大学)

- ・ 高島 哲也 (広島大学)
"特異核関数を持つ連続時間移動平均過程に対する尤度解析"
- ・ 小池 祐太 (東京大学)
"Estimation of the number of relevant factors from high-frequency data"
- ・ 永井 圭二 (横浜国立大学)
"Local Asymptotic Optimality of Equivariant Sequential Estimation in Autoregressive Process" (with Kohtaro Hitomi, Yoshihiko Nishiyama, and Junfan Tao)

【昼休み】 (12:00-13:10)

【セッション3 (優秀報告賞セッション)】 (13:10-14:50)

座長： 植松 良公 (一橋大学)

- ・ 宜 鯤 (京都大学) [オンライン報告]
"Smoothed Bootstrap Based Shrinkage Density Estimation"
- ・ 田川 颯人 (東京大学)
"Bayesian synthetic control method with spillover effects: Estimating the economic costs of the 2011 Sudan split"
- ・ 豊田 雅樹 (一橋大学)
"Robust Reproducible Network Detection"
- ・ 岡本 優太 (京都大学)
"Kernel Choice Matters for Boundary Inference Using Local Polynomial Density: With Application to Manipulation Testing"

【セッション4 (優秀報告賞セッション)】 (14:55-16:10)

座長： 山田 宏 (広島大学)

- ・ 西 幹仁 (一橋大学)
"Testing for Stationary or Persistent Coefficient Randomness in Predictive Regressions"
- ・ 覃雷 (チンレイ) (京都大学) [英語で報告]
"Doubly Robust Uniform Confidence Bands for Group-Time Conditional Average Treatment Effects in Difference-in-Differences"
- ・ 宮治 奨 (東京大学)
"Instrumented differences-in-differences with heterogeneous treatment effects"

【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)】

(16:15-17:30)

座長： 西山 慶彦 (京都大学)

- ・ 坂口 翔政 (東京大学)
"Policy Learning for Optimal Dynamic Treatment Regimes with Observational Data"
- ・ 岡 達志 (慶應義塾大学)
"Regression adjustment for estimating distributional treatment effects in randomized controlled trials" (with Shota Yasui, Yuta Hayakawa, and Shuting Wu)
- ・ 奥井 亮 (東京大学)
"Uniform confidence band for marginal treatment effect function" (with 津田俊樹)

【セッション6】 (17:35-18:25)

座長： 人見 光太郎 (京都工芸繊維大学)

- ・ 加藤 隆太 (広島大学)
"Modal Regression for Network Data" (with Harold D. Chiang and Yuya Sasaki)
- ・ 星野 匡郎 (早稲田大学)
"A Distributional Spatial Autoregressive Model"

【18:25-18:40】 優秀報告賞表彰式

【19:00-21:00】 懇親会

● 2024年1月7日(日)

【セッション7】 (9:00-10:15)

座長： 新谷 元嗣 (東京大学)

- ・ 蔣 佩芸 (東京都立大学)
"Revisiting Asymptotic Theory for Principal Component Estimators of Approximate Factor Models" (with Yoshimasa Uematsu and Takashi Yamagata)
- ・ 蛭川 雅之 (龍谷大学)
"Sufficient dimension reduction meets two-sample regression estimation"
- ・ 黒住 英司 (一橋大学)
"Testing for a Bubble with Stochastically Varying Explosive Coefficient" (with 西幹仁)

【セッション8】 (10:20-12:00)

座長： 奥井 亮 (東京大学)

- ・ 石原 卓弥 (東北大学) [オンライン報告]
"Salvaging failed regression discontinuity designs" (with 坂口翔政 and 澤田真行)
- ・ 難波 慶成 (東京大学)
"Nonparametric Partial Identification for Causal Inference on Intergenerational Income Mobility"
- ・ 津田 俊樹 (東京大学)
"Treatment Effects with Multidimensional Unobserved Heterogeneity: Identification of the Marginal Treatment Effect"
- ・ 武石 将大 (統計数理研究所)
"Hypothesis Testing for Treatment Effect Heterogeneity via an Adaptively Augmented Debiased Estimator"

【昼休み】 (12:00-13:10)

【セッション9】 (13:10-14:25)

座長： 福重 元嗣 (大阪大学)

- ・ 西埜 晴久 (広島大学)
"国民生活基礎調査の個票データを用いた所得不平等度の分析"
- ・ 縄田 和満 (一橋大学/東京大学)
"Risk factors for heart, cerebrovascular, and kidney diseases: Evaluation of potential side effects of medications to control hypertension, hyperglycemia, and hypercholesterolemia"
- ・ 刈屋 武昭 (名古屋商科大学)
"A Modelling Framework for Regression with Collinearity and Effectiveness of t-Test"

【セッション10】 (14:30-15:45)

座長： 谷崎 久志 (大阪大学)

- ・ 伏島 光毅 (一橋大学)
"Identification and estimation of treatment effects in a linear factor model with fixed number of time periods" (with 石原 卓弥)
- ・ 木戸 大道 (京都大学)
"Incorporating Preferences Into Treatment Assignment Problems"
- ・ 白井 洸志 (関西学院大学)
"An ordinal approach to the empirical analysis of games with monotone best responses" (with Natalia Lazzati and John K.-H. Quah)

【セッション11】 (15:50-17:30)

座長： 末石 直也 (神戸大学)

- ・ 鍵原 理人 (大阪学院大学) [オンライン報告]
"合成変換を通じた連続分布族の生成と幾つかの応用例"
- ・ 陶 俊帆 (京都大学)
"An application of law of integrated logarithm to Dickey Fuller test" (with Keiji Nagai)
- ・ 山崎 大輔 (九州大学)
"Testing for a structural break in panel data models under general form of cross-section dependence"
- ・ 王文傑 (Nanyang Technological University)
"A Conditional Linear Combination Test with Many Weak Instruments"



・東千田キャンパス・東千田未来創生センター M303 教室

<https://www.hiroshima-u.ac.jp/access/sendai>



・懇親会：徳の風 サカナ屋 (2024年1月6日(土): 19:00~21:00)

<https://www.hotpepper.jp/strJ000027180/>