

## 2015年度（第23回）関西計量経済学研究会・プログラム

- ・日程： 2016年1月9日（土），10日（日）
- ・場所： 東京大学経済学研究科・小島ホール2Fコンファレンスルーム
- ・懇親会：伊藤国際学術研究センター（2016年1月9日（土）18:15～20:15）
- ・共催：
  - 東京大学経済学研究科・応用統計ワークショップ
  - 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) #2624502
  - 「経済・金融多変量データのベイズモデリングと政策・行動の確率的評価」
  - 日本学術会議 経済学委員会 数量的経済・政策分析分科会

## ● 2016年1月9日(土)

## 【セッション1】（9:30-11:00）

- 座長： 中島 上智（日本銀行）
- ・入江 薫（Department of Statistical Science, Duke University）
- Fox News Network Data Analysis: Bayesian Dynamic Modeling
- ・マクリン 謙一郎（Department of Statistical Science, Duke University）
- Bayesian Predictive Synthesis (Mike Westと共著)
- ・中島 上智（日本銀行）
- Bayesian analysis of multivariate stochastic volatility with skew return distribution

## 【セッション2】（11:10-12:10）

- 座長： 飯塚 信夫（神奈川大学経済学部）
- ・松下 幸敏（東京工業大学情報理工学研究科）
- Nonparametric Likelihood for Volatility under High frequency data (Camponovo, L, T., Otsuと共著)
- ・飯塚 信夫（神奈川大学経済学部）
- GDP速報改定の特徴と、推計が抱える問題点について

## 【昼休み】（12:10-13:10）

## 【セッション3】（13:10-14:40）

- 座長： 黒住 英司（一橋大学経済学研究科）
- ・岩澤 政宗（京都大学経済学研究科）
- Optimal Minimax Rates of Specification Tests for IV Regression
- ・山崎 大輔（一橋大学経済学研究科）
- Testing for Shifts in Mean with Monotonic Power against Multiple Structural Changes
- ・黒住 英司（一橋大学経済学研究科）
- Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors

## 【セッション4】（14:50-15:50）

- 座長： 塚原 英敦（成城大学経済学部）
- ・塚原 英敦（成城大学経済学部）
- The empirical beta copula
- ・田中 勝人（学習院大学経済学部）
- Limiting local powers and power envelopes of panel AR and MA unit root tests and panel stationarity tests

## 【セッション5】 (16:00-18:00)

座長：久保川 達也 (東京大学経済学研究科)

・竹村 彰通 (東京大学情報理工学系研究科)

最近の活動報告：統計検定, 学術会議; HGM法, ゲーム論的確率論

・矢島 美寛 (東京大学経済学研究科)

On discrete Fourier transforms of irregularly spaced spatial data and their applications

・國友 直人 (東京大学経済学研究科)

「経済時系列におけるジャンプ・ノイズ・稀な現象の計量分析」(Jumps, Noises and Rare Events in Economics Time series)

## 【懇親会】 (18:15-20:15)

## ● 2016年1月10日(日)

## 【セッション6】 (9:00-10:30)

座長：姚 峰 (香川大学経済学部)

・姚 峰 (香川大学経済学部)

Stock Market Causal Relationships between the U.S. and East Asian Countries

・栗田 高光 (福岡大学経済学部)

Modeling the nexus of US monetary policy rule and inflation over the past quarter century (Han Gwang Chooと共著)

・市村 英彦 (東京大学経済学研究科)

The influence function of semiparametric estimators (Whitney Newey (MIT) と共著)

## 【セッション7】 (10:40-12:10)

座長：竹内 恵行 (大阪大学経済学研究科)

・竹内 恵行 (大阪大学経済学研究科)

UCL応用統計学科と統計学者ネットワーク: 1911-1933

・刈屋 武昭

ショッピングセンターの戦略的経営—リアル・オプション・アプローチ

・縄田 和満 (東京大学工学系研究科)

Comparison of the length of stay and medical expenditures among Japanese hospitals for type 2 diabetes treatments: The Box-Cox transformation model under heteroscedasticity

## 【昼休み】 (12:10-13:10)

## 【セッション8】 (13:10-14:40)

座長：下津 克己 (東京大学経済学研究科)

・下津 克己 (東京大学経済学研究科)

Testing the Number of Components in Normal Mixture Regression Models

・茂木 快治 (早稲田大学 政治経済学術院)

Testing for Money Illusion Hypothesis in Aggregate Consumption Function: Mixed Data Sampling Approach (Akira Sadahiroと共著)

・久田 貴紀 (大阪大学経済学研究科)

Female Intrapreneurship (安達貴教と共著)

## 【セッション9】 (14:50-16:20)

座長：大森 裕浩 (東京大学経済学研究科)

・高梨 耕作 (慶応大学経済学研究科)

Pointwise Asymptotic Normality of Concave Extended Linear Model

・菅原 慎矢 (東京大学情報理工学系研究科)

A Basket Two-Part Model to Analyze Medical Expenditure on Interdependent Multiple Sectors (Tienyi Wu, Kenji Yamanishiと共著)

・今泉 允聡 (東京大学経済学研究科)

Approximation method for discrete Markov decision model with large state space