

2013年度関西計量経済学研究会

共催：日本学術会議「数量的経済・政策分析分科会」, 文部科学省科学研究費 22240030, 22330067

2014年1月11日(土) 12日(日)

会場：京都大学 法経第三教室(法経東館2階)

プログラム

1月11日(土)

9:30 開会

9:30-10:30 **Session 1 (in Japanese)** 座長：末石 直也(京都大学)

1. 北沢 良継(九州産業大学)
Exploration of Dynamic Fixed Effects Logit Models from a Traditional Angle
2. 柳 貴英(京都大学、学振DC)
Dynamic Panel Data Analysis When The Dynamics Are Heterogeneous

10:30-10:45 Break

10:45-11:45 **Session 2 (in Japanese)** 座長：人見 光太郎(京都工芸繊維大学)

1. 末石 直也(京都大学)
ロジスティック回帰と WinExpectancy による勝率予測
2. 岩澤 政宗(京都大学、学振DC)
The Impact of Remittances and Migration on Household Investments in Rural Cambodia

11:45-13:00 Lunch

13:00-15:00 **特別セッション「モデル選択、モデル平均法」(in English)** 座長：西山 慶彦(京都大学)

1. 黒住 英司(一橋大学)
Information Criteria and Model Selection
2. 安道 知寛(慶應義塾大学)
Recent Trends and Developments in Model Averaging
3. 新谷 元嗣(東京大学)
Quasi-Bayesian Model Selection

15:00–15:15 Break

15:15–16:30 **Session 3 (in English)** 座長：小西 葉子（経済産業研究所）

1. Yoon-Jae Whang (Seoul National University) (45 minutes)
Testing for a General Class of Functional Inequalities
2. Didit B. Nugroho (関西学院大学)
Realized Non-Linear Stochastic Volatility Model with Leverage Effect and Skewed Student t-Error Distributions

16:30–16:45 Break

16:45–18:15 **Session 4 (in English)** 座長：川崎 能典（統計数理研究所）

1. 王文傑（京都大学）
Bootstrap Inference with Many Moment Conditions
2. 崔 庭敏（京都大学）
Partial Identification of Treatment Effects Using Instrumental Variables
3. 金 燕春（京都大学）
Nonparametric Tests for The Effect of The Treatment on Conditional Variance

18:30–20:30 討論会 会場：カンフォーラ（京都大学構内）

1月12日（日）

9:30–10:30 **Session 5 (in Japanese)** 座長：奥井 亮（京都大学）

1. 劉 慶豊（小樽商科大学）
Adaptive Model Averaging Combination Method Based on OLS and GLS Estimators
2. 中西 勇人（東京工業大学）
How The Change of Risk Announcement on Catastrophic Disaster Affects Property Prices?

10:30–10:45 Break

10:45–12:15 **Session 6 (in Japanese)** 座長：大屋 幸輔（大阪大学）

1. 山崎 大輔（一橋大学）

Improving The Finite Sample Performance of Tests for a Shift in Mean

2. 木下 亮（大阪大学）

時系列間の因果性の変化の検定

3. 米倉 頌人（大阪大学）

Does Technology Shock Cause Job Polarization?

12:15–13:45 Lunch

13:45–15:15 **Session 7 (in Japanese)** 座長：黒住 英司（一橋大学）

1. 矢部 竜太（一橋大学、学振 PD）

Empirical Likelihood for Nonlinear Nonstationary Regression Model

2. 植松 良公（一橋大学、学振 PD）

Penalized Likelihood Estimation in High Dimensional Time Series and Its Applications

3. 松木 隆（大阪学院大学）

Linear and Nonlinear Comovement in Southeast Asian Local Currency Bond Markets: A Stepwise Multiple Testing Approach

15:15–15:30 Break

15:30–16:30 **Session 8 (in Japanese)** 座長：谷崎 久志（大阪大学）

1. 星野 匡郎（東京工業大学、学振 PD）

Simulation-Based Estimation of Models with Conditional Moment Restrictions

2. 蛭川 雅之（摂南大学）

Instrument-Free Estimation of Differentiated Products Models Using Cost Data

16:30 閉会