Recent Developments in Statistics and Econometrics

~ In Honor of Hirotugu Akaike ~

Date:　06 – 08 November 2008

Symposium Venue:　Shiran–kaikan, Kyoto University,

KYOTO, JAPAN

Program

* Speaker

■■■■■■■■　06 November, 2008　■■■■■■■■

<　9:45 ~ 10:25 >　　Registration
< 10:25 ~ 10:30 >　　Opening Address
　　　　　　　　　　Y. Nishiyama (Kyoto University)

Session 1 < 10:30 ~ 11:50 >　　Semiparametric regression
　　　　　　　　　　Chair:　Y. Nishiyama (Kyoto University)

10:30〜11:10　　Efficient Estimation in Partially Linear Additive Models
　　　　　　　　　B. U. Park (Seoul National University)

11:10〜11:50　　Difference-based Estimation for Semiparametric Varying-Coefficient
　　　　　　　Partially Linear Models
　　　　　　　　　J. Fan (Princeton University)
　　　　　　　　*Q. F. Liu (Kyoto University)
　　　　　　　　　Y. Wu (North Carolina State University)

〜〜〜〜〜〜〜〜　＜Lunch＞　〜〜〜〜〜〜〜〜

Session 2　<14:00 ~ 16:00>　Stochastic processes I
　　　　　　　　　　　　　　Chair:　M. Taniguchi (Waseda University)

14:00〜14:40　　Asymptotics of sequential tests for some Markov chains via
　　　　　　　　convergence to diffusion
　　　　　　　　　　　*K. Nagai (Yokohama National University)
　　　　　　　　　　　K. Hitomi (Kyoto Institute of Technology)
　　　　　　　　　　　Y. Nishiyama (Kyoto University)

14:40〜15:20　　Lower bounds for densities of stationary distributions of diffusion
　　　　　　　　processes
　　　　　　　　　　　S. Shaposhnikov　(Moscow State University)

15:20〜16:00　　Statistical Inference for stationary solutions of affine stochastic delay
　　　　　　　　differential equations
　　　　　　　　　　　A. Gushchin (Steklov Mathematical Institute)

〜〜〜〜〜〜〜〜〜　　＜**Coffee Break**＞　　〜〜〜〜〜〜〜〜〜

Session 3 < 16:30 ~ 17:50 >　　Distribution Theory I
　　　　　　　　　　　　　　Chair:　J. Hirukawa (Niigata University)

16:30〜17:10　　The problem of boundary estimates of the shape parameter of the
　　　　　　　　scalarSkew--Normal and Skew--t distribution: an alternative
　　　　　　　　solution to maximum likelihood
　　　　　　　　　　　L. Greco (University of Sannio)

17:10〜17:50　　Skew-t distribution: Inferential and robusteness aspects
　　　　　　　　　　　*A. C. Monti (University of Sannio)
　　　　　　　　　　　T. J. DiCiccio (Cornell University)

＜18：00〜20：00　Conference party (@ Camphora on Campus)＞

Session 4 < 9:00 ~ 10:20 >   Financial Statistics
                    Chair: Y. Kawasaki (Institute of Statistical Mathematics)

9:00〜 9:40   Evolution of Dependence Structures in International Equity Markets
                    T. Okimoto (Hitotsubashi University, UCSD)

9:40〜10:20   Resampling Procedure in estimation of Optimal Portfolios for Time
                    -Varying ARCH Processes
                    H. Shiraishi (Waseda University)

〜〜〜〜〜〜〜〜   ＜**Coffee Break**＞   〜〜〜〜〜〜〜〜

Session 5 < 10:40 ~ 12:00 >   Distribution theory II
                    Chair: K. Hitomi (Kyoto Institute of Technology)

10:40〜11:20   On The First-Significant Digit Law
                    A. Kulikova (Moscow State University)

11:20〜12:00   Triangular transformations of multidimensional probability distributions
                    V. Bogachev (Moscow State University)

〜〜〜〜〜〜〜〜   ＜**Lunch**＞   〜〜〜〜〜〜〜〜

Session 6   <14:00 ~ 16:00>   Factor/Component Analysis
                    Chair: H. Ogata (Waseda University)

14:00～14:40   Optimal Rank-based Tests for Principal Component Analysis
                    M. Hallin (Univ. Libre de Bruxelles)
                    D. Paindaveine (Univ. Libre de Bruxelles)
                    *T. Verdebout (Univ. Libre de Bruxelles)

14:40～15:20   Independent component analysis for locally stationary processes
                    *J. Hirukawa (Niigata University)
                    H. Ogata (Waseda University)

15:20～16:00   Dynamic Factors in the Presence of Block Structure
                    *M. Hallin (Univ. Libre de Bruxelles)
                    R. Liska (Univ. Libre de Bruxelles)

            ～～～～～～～～   ＜**Coffee Break**＞   ～～～～～～～～～

Session 7 ＜16:30 ~ 17:50＞   Empirical econometrics
                    Chair: T. Okimoto (Hitotsubashi University, UCSD)

16:30～17:10   Measuring Firm-Specific Productivities
                    H. Ichimura (University of Tokyo)
                    *Y. Konishi (RIETI)
                    Y. Nishiyama (Kyoto University)

17:10～17:50   A monthly volatility index for the US real economy
                    C. Frale (Univ. Libre de Bruxelles)
                    *D. Veredas (Univ. Libre de Bruxelles)

Session 8 < 9:30 ~ 10:50 >   Stochastic Processes II
　　　　　　　Chair: K. Nagai (Yokohama National University)

9:30～10:10　　On the generalized Bayesian and minimax quickest detection
problems for change of intensity of Poisson Process
　　　　　　E. Burnaev (Russian Academy of Sciences)

10:10～10:50　　On the optimal sequential estimation of the position of ultimate
maximum and last zero for Brownian motion observable on finite
interval
　　　　　　A. Shiryaev (Steklov Mathematical Institute)

～～～～～～～～　＜**Coffee Break**＞　～～～～～～～～

Session 9 < 11:10 ~ 12:30 >   Non/Semiparametrics
　　　　　　　Chair:　Y. Konishi (RIETI)

11:10～11:50　　A direct plug-in method for tuning parameter selection in penalized
likelihood estimations
　　　　　　M. Ueki (Institute of Statistical mathematics)

11:50～12:30　　Semiparametric efficiency of Quantile Regression for scale model,
with application to ARCH
　　　　　　H. Taniai (Univ. Libre de Bruxelles)

< 12:30 ~ 12:35 >   Closing Address
　　　　　　　M. Taniguchi (Waseda University)

Sponsorships

We are grateful for the financial assistances from:

Organizers

- Yoshihiko Nishiyama   (Kyoto University)
- Masanobu Taniguchi   (Waseda University)
- Hiroaki Ogata   (Waseda University)

Demachiyanagi Station
出町柳駅

Seifu-Kaikan
清風会館

Hyakumanben
百万遍

Department of Economics
経済学部

Institute of Economic Research
経済研究所

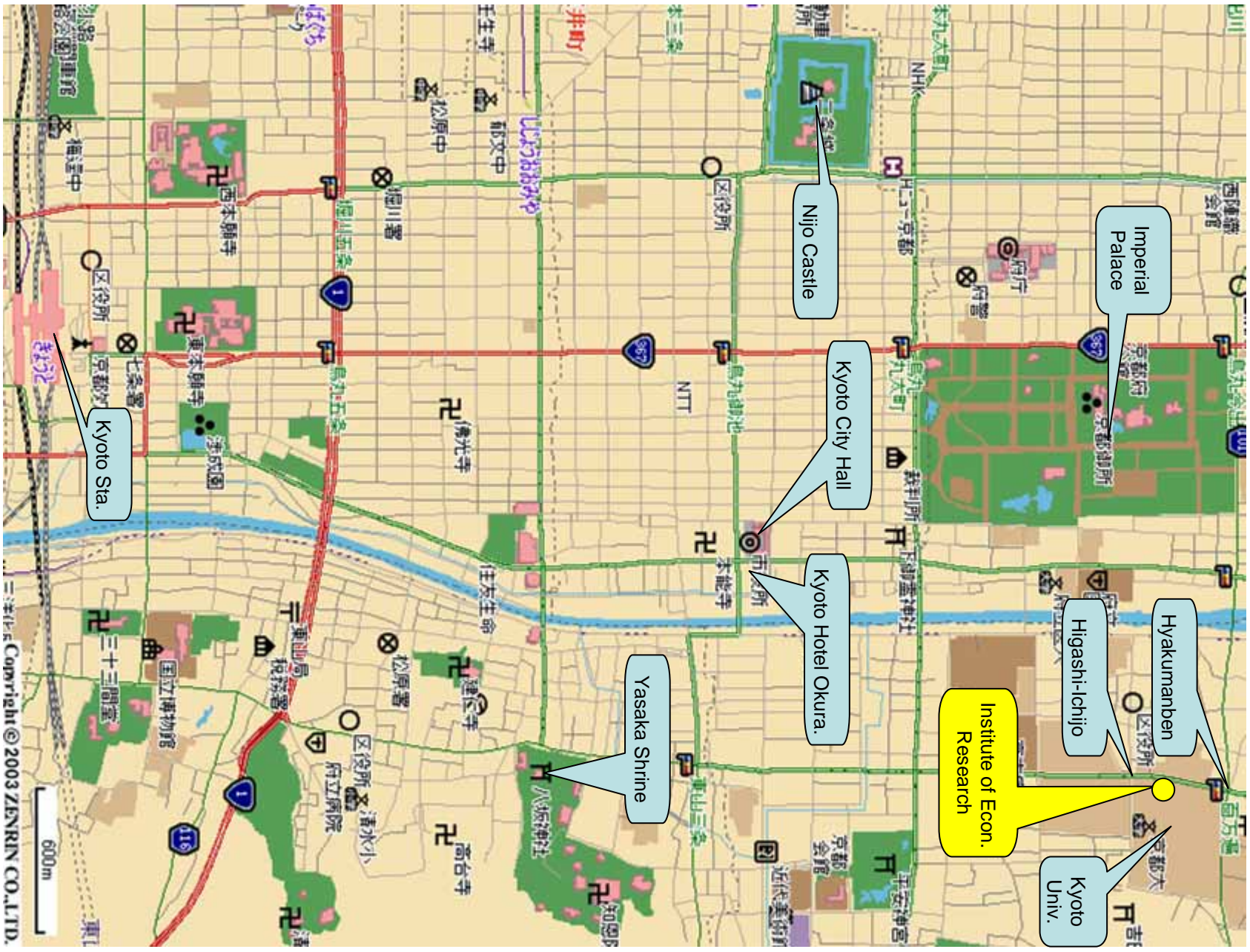Clock Tower
時計台

Higashi-Ichijyo
東一条

Cafe-Restaurant Camphora

Shiran-Kaikan
芝蘭会館

Kyodai-Kaikan
京大会館

Institute of Economic Research

100m