

関西計量経済学研究会 2010 年度研究発表会 プログラム

共 催：日本学術会議「数量的経済・政策分析分科会」
日本統計学会「計量経済・計量ファイナンス分科会」

日 時： 2011年1月8日（土） 10:00～18:45
1月9日（日） 9:15～13:00

場 所： 大阪大学中之島センター 7階講義室2
(<http://www.onc.osaka-u.ac.jp/others/map/index.php>)

1月8日（土）

10:00～12:00 セッション1：座長 福重元嗣（大阪大学）

小林弦矢（神戸大学大学院経営学研究科 D1）*，古澄英男（神戸大学経営学研究科）

“Generalized Multiple-Point Algorithms for Approximate Bayesian Computation”

田中晋矢（一橋大学大学院経済学研究科 D3）*，黒住英司（一橋大学大学院経済学研究科）

“Investigating Finite Sample Properties of Estimators for Approximate Factor Model
When N Is Small”

稲田光朗（京都大学大学院経済学研究科 D2）*，手島健介（Instituto Tecnológico Autónomo de
México）

“The Impact of FDI on Industry Productivity in China: Evidence from a Regulation
Change”

木下 亮（大阪大学大学院経済学研究科 M2）

“Learning process in markets: Sequential trading with Bayesian learning”

12:00～13:30 昼食

13:30～15:00 セッション2（英語セッション）：座長 西山慶彦（京都大学）

Chia-Lin Chang (National Chung Hsing University, Taiwan)*, Chen, S.P., and M. McAleer
(Erasmus University Rotterdam)

“Globalization and Knowledge Spillover: International Direct Investment, Exports and
Patents”

McAleer, Micheal (Erasmus University Rotterdam)*, Jiménez-Martin, J.A. (Universidad
Complutense, Spain), Amaral, T.P. (Universidad Complutense)

“GFC-Robust Risk Management Strategies under the Basel Accord”

Jiménez-Martin, J.A. (Universidad Complutense)

“International evidence on GFC-robust forecasts for risk management under the Basel
Accord”

15:00~15:30 Coffee Break

15:30~16:30 セッション3 (日本学術会議セッション): 座長 大屋幸輔 (大阪大学)
Lee, Yoon-Jin (Indiana University), 奥井 亮 (京都大学経済研究所)*, 新谷元嗣 (Vanderbilt
University)

“Asymptotic Inference for Dynamic Panel AR(∞) Processes”

16:30~16:45 Short Break

16:45~18:45 セッション4: 座長 黒住英司 (一橋大学)

岩倉相雄 (京都大学大学院経済学研究科 M2)*, 奥井亮 (京都大学経済研究所)

“Efficient Estimation of Autocovariances for Panel Data with Individual Effects under
Cross Section and Time Series Asymptotics”

北沢良継 (九州産業大学経済学部)

“A hyperbolic transformation for a fixed effects logit model”

縄田和満 (東京大学大学院工学系研究科)*, 川渕孝一 (東京医科歯科大学大学院)

「多数の病院における白内障手術の在院日数の分析について-2006 年度診療報酬改定に伴う
DPC見直しの影響の評価-」

吉村有博 (京都大学大学院経済学研究科 M2)

“Identification and Estimation of Simultaneous Discrete Games : A Survey”

19:00~21:00 懇親会@「ワインウェアハウス堂島店」

(大阪市福島区福島 1-1-48 THE TOWER OSAKA 1F)

1月9日 (日)

9:15~11:15 セッション5: 座長 谷崎久志 (神戸大学)

赤司健太郎 (統計数理研究所)*, 川崎能典 (統計数理研究所)

「2項モデルの予測によるリスク総額最小化」

黒住英司 (一橋大学大学院経済学研究科)*, 青野幸平 (立命館大学経営学部)

“Estimation and Inference in Predictive Regressions”

劉 慶豊 (小樽商科大学商学部)

“Model Averaging for High Dimension Data”

末石直也 (京都大学大学院経済学研究科)

“Information Criteria for Moment Restriction Models”

11:15~11:30 Short Break

11:30~13:00 セッション6：座長 末石直也（京都大学）

矢部竜太（一橋大学大学院経済学研究科 D1）

“Moderate deviation from a unit root in MA(1)”

植松良公（一橋大学大学院経済学研究科 M2）

“Regression with a Slowly Varying Regressor in the Presence of a Unit Root in Autoregressive Errors”

徐 海峰（神戸大学大学院経済学研究科 M2）

“Risk performance of a pre-test ridge regression estimator under a multivariate t distribution error term when each individual regression coefficient is estimated”

注記： 報告時間は一報告あたり 30 分（討論を含む）。ただしセッション 3 は 60 分。

*印は報告者を表している。