

한국계량경제학의 어제, 오늘 그리고 내일
Econometrics in Korea: Past, Present and Future

2012년 6월 1일 (금)
연세대학교 상경대학 201호 (최고경제인교실)

참석자

강석훈 (성신여대, 국회의원), 김동헌 (고려대), 김인무 (성균관대), 김자봉 (금융연), 김재영 (서울대), 김창식 (성균관대), 김창진 (고려대, 워싱턴대), 김태환 (연세대), 남준우 (서강대), 박상수 (고려대), 박준용 (인디애나대, 성균관대), 백웅기 (상명대), 서병선 (고려대), 송원호 (중앙대), 안형택 (동국대), 유병삼 (연세대), 유병철 (동아대), 윤가원 (국민대), 이기석 (경희대), 이석배 (서울대), 이영훈 (서강대), 이우현 (경희대), 이진 (이화여대), 이한식 (서강대), 정진욱 (연세대), 정희택 (한동대), 조진서 (연세대), 최인 (서강대), 한치록 (고려대), 황윤재 (서울대), 형남원 (서울시립대)

Part I: Lectures

09:00 – 09:50 유병삼 (연세대): Cointegration: An Overview
10:00 – 10:50 황윤재 (서울대): Poissonization and Its Econometric Applications
11:00 – 11:50 박준용 (인디애나대, 성균관대) Regressions at High Frequency

Lunch 12:00 – 13:00

Part II: Conference

Session I: 사회 정진욱 (연세대)

13:00 – 13:20 조진서 (연세대) Higher-Order Expansions of Twofold Unidentified Models When Testing for Neglected Nonlinearity

13:20 – 13:40 김자봉 (금융연) Asymptotically Feasible GLS of Triangular SEM: Non-IV Approach

13:40 – 14:00 박상수 (고려대) Nonparametric Inference for Counterfactual Means: Bias-Correction, Confidence Sets, and Weak IV

14:00 – 14:20 이석배 (서울대) Estimation of a Threshold Model via the Lasso

14:20 – 14:40 김재영 (서울대) Limited Information Quasi-Likelihood and Data-Based Inference for Model Specification

Greetings and Coffee Break 14:40 – 15:00 박준용 (인디애나대, 성균관대)

Session II: 사회 이한식 (서강대)

15:00 – 15:20 최인 (서강대) Efficient Estimation of Nonstationary Factor Models

15:20 – 15:40 한치록 (고려대) Lag Length Selection for Panel Autoregressive Models

15:40 – 16:00 송원호 (중앙대) Bootstrapping Unit Root Tests with Covariates

16:00 – 16:20 김창식 (성균관대) Nonstationarity in Time Series of State Densities

Coffee Break 16:20 – 16:30

Session III: 사회 이기석 (경희대)

16:30 – 16:50 남준우 (서강대) Asset Pricing Theory and the Valuation of Korean Paintings: A Semiparametric Model of Hedonic Pricing

16:50 – 17:10 이우현 (경희대) Financial Factors in an Estimated Small Open Economy: The Case of Korea

17:10 – 17:30 윤가원 (국민대) Let's Take Another Break

17:30 – 17:50 김창진 (고려대, 워싱턴대) Markov-Switching Models with Evolving Regime-Specific Parameters: Are Post-War Booms or Recessions All Alike?

Conclusions 17:50 – 18:00 유병삼 (연세대)

Part III: Reunion

Dinner 18:30 – 20:30 연대동문회관 소연회실

Tel: 02-2123-4760~1

Group Discussions 20:30 – 24:00 장소미정