

Essays on Quantile Regressions

片渕, 結矢

<https://hdl.handle.net/2324/4059977>

出版情報 : Kyushu University, 2019, 博士 (経済学), 課程博士

バージョン :

権利関係 : Public access to the fulltext file is restricted for unavoidable reason (3)

氏名	片渕 結矢			
論文名	Essays on Quantile Regression (分位点回帰に関する研究)			
論文調査委員	主査	九州大学	教授	瀧本 太郎
	副査	九州大学	教授	大西 俊郎
	副査	九州大学	教授	宮崎 毅

論文審査の結果の要旨

本論文は、分位点回帰について、条件付分位点回帰、無条件分位点回帰、内生性に焦点を当て考察した研究である。

第1章では、問題の背景説明の後、研究課題と本論文の貢献についての要約がなされる。第2章では、条件付分位点回帰と無条件分位点回帰の違いについて比較しながら、理論と実証分析の蓄積の両面から先行研究のサーベイを行っている。第3章では、地価データの分布に焦点をあて、地理情報データも活用しながら日本の地価データの変動要因について分析している。第4章では、分位点回帰の枠組みにおける内生性問題を、Ghosh (2016)により提案された推定手法をシミュレーション分析することにより検証している。第5章では、日本における実物経済の活動と地価の関係を、無条件と条件付分位点回帰を用いて分析し、その結果の解釈の違いについて検討している。第6章では、分析のまとめと今後の課題がまとめられている。

本論文の主要な貢献は、(1) 地理情報システム(GIS)データを活用した罰則付分位点回帰分析により、地価の条件付分布の分位点によって説明変数の影響が異なることを示している点、(2) 内生性を考慮せずに無条件分位点回帰を行った場合のバイアスやGhosh (2016)により提案されたコントロール変数アプローチに基づく推定手法によりバイアスが緩和される程度について、それらの小標本パフォーマンスをシミュレーション分析により明らかにしている点、(3) 失業率の無条件分布の分位点により地価の影響が異なることを明らかにした点、などである。

本論文は、条件付分位点回帰と無条件分位点回帰について丁寧に比較している点、実証分析においては内生性も考慮しながら緻密に分析することにより頑健な結果を提示している点、シミュレーション分析ではパラメータの設定を細かく変化させながらその影響を詳細に検討している点に特徴があり、分位点回帰に関する研究に新しい知見をもたらしているものと評価できる。また、GISデータの活用に伴い生じる変数選択問題に対し、複数の罰則項を検討することにより結果の頑健性を慎重に確認している点も評価に値する。

シミュレーション分析においては中央値以外でも比較を行う必要があるなど、本論文を出発点により詳細な解明が望まれるが、これらの点は本論文の価値を損なうものではなく、今後鋭意追求すべき課題に属する。

以上の点から、本論文調査会は、片渕結矢氏から提出された論文“Essays on Quantile Regression”を博士(経済学)の学位を授与するに値するものと認める。