

1. 学歴

- 1992年 3月 一橋大学経済学部卒業
1995年 4月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程入学
1997年 3月 同修了
1997年 4月 同博士後期課程入学
2000年 3月 同修了 (経済学博士取得)

2. 職歴・研究歴

- 1992年 4月 電力中央研究所経済社会研究所研究員 (1994年3月まで)
2000年 4月 日本学術振興会特別研究員 (2000年9月まで)
2000年 10月 一橋大学大学院経済学研究科講師
2003年 4月 一橋大学大学院経済学研究科助教授
2003年 9月 ボストン大学客員研究員 (2005年8月まで)
2006年 4月 京都大学経済研究所客員助教授 (2007年3月まで)

3. 学内教育活動

A. 担当講義名

(a) 学部学生向け

統計学入門

(b) 大学院

上級計量経済学, 中級計量経済学, 中級計量ファイナンス, ワークショップ

B. ゼミナール

学部後期, 大学院

C. 講義およびゼミナールの指導方針

学部の統計学入門は、主に記述統計の解説を行い、データの加工方法を身につけることを目的としている。大学院での講義は、研究者および応用経済学者向けの、中・上級の講義を担当している。計量経済学・時系列分析に関する専門的な論文を理解するために必須の理論を解説する一方、実際のデータを用いて各種統計量をコンピュータで計算する方法も解説している。

学部ゼミでは、数理統計学・計量経済学の基礎理論を習得し、実際の経済分析にどのように応用していくか指導している。一方、大学院ゼミでは、研究者養成を目指し、時系列分析の理論構築能力を習得できるよう、指導している。

4. 主な研究テーマ

定常・非定常時系列分析に関する理論を広く研究しているが、最近の研究テーマは以下の通りである。

- (1) 共和分回帰における DOLS 推定量の特性について
- (2) 共和分に関する統計的推測
- (3) 構造変化に付随する諸問題

5. 研究活動

A. 業績

(a) 著書・編著

『穴埋め式統計数理らくらくワークブック』(藤田岳彦監修), 講談社, 1993年, 168頁。

(b) 論文(査読つき論文には*)

"Essays on Testing for Stationarity Possibly with Seasonality and a Structural Change," Ph.D. Thesis submitted to Hitotsubashi University, 2000.

* "Modified Lag Augmented Vector Autoregressions," (with Taku Yamamoto), *Econometric Reviews*, 2000.

* "Finite Sample Properties of the Test for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," (with Taku Yamamoto), *Proceedings of International Congress on Modelling and Simulation 2001*, Modelling and Simulation Society of Australia and New Zealand Inc., 2001.

* "Testing for Stationarity with a Break," *Journal of Econometrics*, 2002.

* "The Limiting Properties of the Canova-Hansen Test Under Local Alternatives," *Econometric Theory*, 2002.

* "Testing for Periodic Stationarity," *Econometric Reviews*, 2002.

* "Some Properties of the Point Optimal Invariant Test for the Constancy of Parameters," *Journal of the Japan Statistical Society*, 2003.

* "The Rank of a Sub-Matrix of Cointegration," *Econometric Theory*, 2005.

* "Detection of Structural Change in the Long-Run Persistence in a Univariate Time Series," *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 2005.

* "Equivalence of Two Expressions of the Impact Matrix," (with Hiroaki Chigira and Taku Yamamoto), *Econometric Theory*, 2005.

"Lag Augmentation in Regression Models with Possibly Integrated Regressors," (with Taku Yamamoto), *Hitotsubashi Journal of Economics*, 2005.

* "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," (with Taku Yamamoto), *Journal of Time Series Analysis*, 2006.

* "The Wald-Type Test of a Normalization of Cointegrating Vectors," *Journal of the Japan Statistical Society*, 2007 (forthcoming).

* "Efficient Estimation and Inference in Cointegrating Regressions with Structural Change (with Yoichi Arai)," *Journal of Time Series Analysis*, 2007 (forthcoming).

B. 最近の研究活動

(a) 国内外学会発表

「共和分行列の部分行列のランクの検定」日本統計学会, 明星大学, 2002年9月。

"Detection of Structural Change in the Long-Run Persistence in a Univariate Time Series," 日本経済学会, 広島大学, 2002年10月。

"Point Optimal Test for Cointegration With Unknown Variance-Covariance Matrix," 日本経済学会, 福島大学, 2006年6月。

"Point Optimal Test for Cointegration With Unknown Variance-Covariance Matrix," Australasian Meeting of the Econometric Society, オーストラリア, 2006年7月。

"Efficient Estimation and Inference in Cointegrating Regressions with Structural Change," 日本統計学会, 東北大学, 2006年9月。

(b) 国内研究プロジェクト

「数理ファイナンスのための統計理論と時系列分析による検証」文部科学省科学研究費補助金基盤研究(A)(2), 2002年度-2003年度, 研究分担者

「パネル・データ分析の計量理論と実証分析」文部科学省科学研究費補助金基盤研究(A)(2), 2005年度-, 研究分担者

「定常・非定常経済モデルの構造変化に関する統計的推測」文部科学省科学研究費補助金若手研究(B), 2006年度-, 研究代表者

6. 学内行政

(b) 学内委員会

広報委員会委員 (2002年4月-2003年8月)

経営企画委員会情報化推進部会委員 (2005年4月-)

広報委員会広報専門委員会 Web 部会委員 (2005年4月-2006年4月)

入学試験実施専門委員会電算部会委員 (2005年8月-)

情報処理・教育システム仕様策定委員会委員 (2006年2月-)

7. 学外活動

(a) 参加学会および学術活動

日本統計学会

日本経済学会

Econometric Society