ふりがな　　くろずみ　　えいじ

氏 名　　**黒住 英司**

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（2007 年 4 月より准教授）
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Ⅰ，中級計量経済学，中級計量ファイナンス，特別講義，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)構造変化に付随する諸問題

(2)時系列モデルおよびパネルデータモデルにおける定常性の検定

(3)共和分に関する諸問題

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，2003 年，168 頁。

『統計学』(森棟公夫，照井伸彦，中川満，西埜晴久，黒住英司著)，有斐閣，2008 年，485 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.

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

"Variable Lag Augmentation in Regression Models wit Possibly Integrated Regressors: Some Experimental Results," (with Taku Yamamoto), *Hiroshima Economic Review* , 2007.

* "Testing for the Null Hypothesis of Cointegration with a Structural Break," (with Yoichi Arai), *Econometric Reviews*, 2007.

＊"Test for the Null Hypothesis of Cointegration with Reduced Size Distortion," (with Yoichi Arai), *Journal of Time Series Analysis*, 2008.

＊「経済時系列分析と単位根検定：これまでの発展と今後の展望」『日本統計学会誌（シリーズ J）』, 2008 年。

＊"The Role of "Leads" in the Dynamic OLS Estimation of Cointegrating Regression Models," (with Kazuhiko Hayakawa), *Mathematics and Computers in Simulation*, 2008.

＊"Asymptotic Properties of the Efficient Estimators for Cointegrating Regression Models with Serially Dependent Errors," (with Kazuhiko Hayakawa), *Journal of Econometrics*, 2009 (forthcoming).

（d）その他

"Construction of Stationarity Tests with Less Size Distortion," Discussion Paper No. 005-12, Graduate School of Economics, Hitotsubashi University, 2005.

"Model Selection Criteria for the Leads-and-Lags Cointegrating Regression," (with In Choi), Global COE Hi-Stat Dsicussion Paper Series 006, Hitotsubashi University, 2008.

"A Simple Panel Stationarity Test in the Presence of Cross-Sectional Dependence," (with Kaddour Hadri), Global COE Hi-Stat Dsicussion Paper Series 016, Hitotsubashi University, 2008.

B. 最近の研究活動

（a）国内外学会発表（基調報告・招待講演には*）

"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 Chang," 日本統計学会, 東北大学, 2006 年 9 月。

"Asymptotic Properties of the Efficient Estimators for Cointegrating Regression Models with Serially Dependent Errors," The Third Symposium on Econometric Theory and Applications, 香港科学技術大学, 2007 年 4 月。

"A Simple Panel Stationarity Test in the Presence of Cross-Sectional Dependence," New Zealand Econometric Study Group Metting, オークランド大学, 2008 年 3 月。

"A Simple Panel Stationarity Test in the Presence of Cross-Sectional Dependence," EEA-ESEM Meeting, ボッコーニ大学, 2008 年 8 月。

"A Simple Panel Stationarity Test in the Presence of Cross-Sectional Dependence," 日本統計学会, 慶應義塾大学, 2008 年 9 月。

＊「共和分分析と共和分ベクトルの標準化」, 日本統計学会, 慶應義塾大学（第 22 回日本統計学会小川研究奨励賞受賞記念講演）, 2008 年 9 月。

＊「経済時系列分析：単位根検定と検出力」, 日本経済学会, 近畿大学, 2008 年 9 月。

（b）国内研究プロジェクト

「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 － 2007 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 – 2008 年度, 研究代表者

「社会科学の統計分析拠点構築」21 世紀 COE プログラム(文部科学省研究拠点形成費補助金), 2006 – 2007 年度, 事業推進担当者

「社会科学の高度統計・実証分析拠点構築」グローバル COE プラグラム(文部科学省研究拠点形成費補助金), 2008-2012 年度, 事業推進担当者(統計理論班グループ副リーダー)

(d) 研究集会オーガナイズ

国際交流セミナー, 2006 年 6 月 21 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2006 年 12 月 19 日, 一橋大学

"The Third Symposium on Econometric Theory and Applications," 2007 年 4 月 13 日-15 日, 香港科学技術大学

国際交流セミナー, 2007 年 6 月 5 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2007 年 6 月 8 日, 一橋大学

"Hitotsubashi Conference on Econometrics 2007," 2007 年 11 月 24 日-25 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2008 年 5 月 21 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2007 年 9 月 30 日, 一橋大学

C. 受賞

第 22 回小川研究奨励賞(論文"The Wald-Type Test of a Normalization of Cointegrating Vectors"に対して), 日本統計学会, 2008 年

6. 学内行政

(b) 学内委員会

経営企画委員会情報化推進部会(2005 年 4 月 – 2007 年 3 月)

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

入学試験実施専門委員会電算部会(2005 年 8 月 – 2007 年 3 月)

情報処理・教育システム仕様策定委員会(2006 年 2 月 – 2007 年 3 月)

22 クラス顧問(2006 年 4 月 – 2008 年 3 月)

教育力開発プロジェクト(2007 年 4 月 –)

全学アプリケーション検討専門委員会(2007 年 11 月 –)

評価委員会(研究科内)(2007 年 12 月 –)

FD 委員会(研究科内)(2007 年 12 月 –)

7.学外活動

(b) 所属学会および学術活動

日本統計学会(理事: 2005 年 9 月 – 2008 年 9 月)

日本経済学会

Econometric Society

9. 一般的言論活動

「ミステリーを科学したら」,『HQ Book Review』, 2008 年春号(Vol. 19) 。

「株・日経平均株価」「経済・学問」「経済学部・大学」「数学・ファイナンシャル・プランナー」「文系・文理選択」「格差社会」に対するアプローチ, 『夢ナビ Web（（株）フロムページ）』, 2009 年 1 月。