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）
2009 年 10 月　一橋大学大学院経済学研究科教授

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，統計学

（b）大学院

上級計量経済学Ⅰ，中級計量経済学，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，時系列分析およびパネル・データ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・非定常時系列分析およびパネル・データ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。

『経済時系列ハンドブック』(「非定常性と単位根検定・構造変化検定」執筆)，(刈屋武昭，前川功一，矢島美寛，福地純一郎，川崎能典編)，朝倉書店，2012 年，

(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*, Vol.19, No.2, 2000, pp.207-231.

* "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, pp.1243-1248.

* "Testing for Stationarity with a Break," *Journal of Econometrics*, Vol.108, No.1, 2002, pp.63-99.

* "The Limiting Properties of the Canova-Hansen Test Under Local Alternatives," *Econometric Theory*, Vol.18, No.5, 2002, pp.1197-1220.

* "Testing for Periodic Stationarity," *Econometric Reviews*, Vol.21, No.2, 2002, pp.243-270.

* "Some Properties of the Point Optimal Invariant Test for the Constancy of Parameters," *Journal of the Japan Statistical Society*, Vol.33, No.2, 2003, pp.169-180.

* "The Rank of a Sub-Matrix of Cointegration," *Econometric Theory*, Vol.21, No.2, 2005, pp.299-325.

* "Detection of Structural Change in the Long-Run Persistence in a Univariate Time Series," *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, Vol.67, No.2, 2005, pp.181-206.

* "Equivalence of Two Expressions of the Impact Matrix," (with Hiroaki Chigira and Taku Yamamoto), *Econometric Theory*, Vol.21, No.4, 2005, pp.870-875.

"Lag Augmentation in Regression Models with Possibly Integrated Regressors," (with Taku Yamamoto), *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.46, No.2, 2005, pp.159-175.

* "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," (with Taku Yamamoto), *Journal of Time Series Analysis*, Vol.27, No.5, 2006, pp.703-723.

* "The Wald-Type Test of a Normalization of Cointegrating Vectors," *Journal of the Japan Statistical Society*, Vol.37, No.2, 2007, pp.191-205.

* "Efficient Estimation and Inference in Cointegrating Regressions with Structural Change," (with Yoichi Arai), *Journal of Time Series Analysis*, Vol.28, No.4, 2007, pp.545-575.

"Variable Lag Augmentation in Regression Models with Possibly Integrated Regressors: Some Experimental Results," (with Taku Yamamoto), *Hiroshima Economic Review*, Vol.31, No.1, 2007, pp.21-34.

* "Testing for the Null Hypothesis of Cointegration with a Structural Break," (with Yoichi Arai), *Econometric Reviews*, Vol.26, No.6, 2007, pp.705-739.

* "Test for the Null Hypothesis of Cointegration with Reduced Size Distortion," (with Yoichi Arai), *Journal of Time Series Analysis*, Vol.29, No.3, 2008, pp.476-500.

*「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）』, Vol.38, No.1, 2008 年, 39-57 頁。

* "The Role of "Leads" in the Dynamic OLS Estimation of Cointegrating Regression Models," (with Kazuhiko Hayakawa), *Mathematics and Computers in Simulation*, Vol.79, No.3, 2008, pp.555-560.

* "Asymptotic Properties of the Efficient Estimators for Cointegrating Regression Models with Serially Dependent Errors," (with Kazuhiko Hayakawa), *Journal of Econometrics*, Vol.149, No.2, 2009, pp.118-135.

"Construction of Stationarity Tests with Less Size Distortions," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.50, No.1, 2009, pp.87-105.

* "Reducing the Size Distortion of the KPSS Test," (with Shinya Tanaka), *Journal of Time Series Analysis*, Vol.31, No.6, 2010, pp.415-426.

* "Model Selection Criteria in Multivariate Models with Multiple Structural Changes," (with Purevdorj Tuvaandorj), *Journal of Econometrics*, Vol.164, No.2, 2011, pp.218-238.

"A Locally Optimal Test for No Unit Root in Cross-Sectionally Dependent Panel Data," (with Kaddour Hadri), *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.52, No.2, 2011, pp.165-184.

* "A Simple Panel Stationarity Test in the Presence of Serial Correlation and a Common Factor," (with Kaddour Hadri), *Economics Letters*, Vol.115, No.1, 2012, pp.31-34.

* "Model Selection Criteria for the Leads-and-Lags Cointegrating Regression," (with In Choi), *Journal of Econometrics*, Vol.169, No.2, 2012, pp.224-238.

* "Investigating Finite Sample Properties of Estimators for Approximate Factor Models When N Is Small," (with Shinya Tanaka), *Economics Letters*, Vol.116, No.3, 2012, pp.465-468.

* "Testing the Prebish-Singer Hypothesis Using Second Generation Panel Data Stationarity Tests with Break," (with Rabah Arezki, Kaddour Hadri and Yao Rao), *Economics Letters*, Vol.117, No.3, 2012, pp.814-816.

（d）その他

"Statistical Inference in Possibly Integrated/Cointegrated Vector Autoregressions: Application to Testing for Structural Changes," (with Khashbaatar Dashtseren), Global COE Hi-Stat Discussion Paper Series 187, Hitotsubashi University, 2011.

"Estimation and Inference in Predictive Regressions," (with Kohei Aono), Global COE Hi-Stat Discussion Paper Series 192, Hitotsubashi University, 2011.

"Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," Global COE Hi-Stat Discussion Paper Series 227, Hitotsubashi University, 2012.

"Covariate Unit Root Test for Cross-Sectionally Dependent Panel Data," (with Daisuke Yamazaki and Kaddour Hadri), Global COE Hi-Stat Discussion Paper Series 256, Hitotsubashi University, 2012.

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*）

"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。

* "Determining the Number of Structural Breaks in Vector Autoregressive Processes by Model Selection Criteria," IMS Asia Pacific RIM Meeting, ソウル大学, 2009 年 7 月。

"Determining the Number of Structural Breaks in Vector Autoregressive Processes by Model Selection Criteria," 日本統計学会, 同志社大学, 2009 年 9 月。

"Model Selection Criteria for Multivariate Models with Multiple Structural Changes," 関西計量経済研究会, 京都大学, 2010 年 1 月。

"Estimation and Inference in Predictive Regressions," 関西計量経済研究会, 大阪大学, 2011 年 1 月。

"Estimation and Inference in Predictive Regressions," Asian Meeting of Econometric Society, 高麗大学, 2011 年 8 月。

"Statistical Inference in Possibly Integrated/Cointegrated Vector Autoregressions: Application to Testing for Structural Changes," 統計関連学会連合大会, 九州大学, 2011 年 9 月。

"Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," 関西計量経済研究会, 神戸大学, 2012 年 1 月。

"Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," The 2012 International Symposium on Econometric Theory and Applications, 上海交通大学, 2012 年 5 月。

"Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," 日本経済学会, 北海道大学, 2012 年 6 月。

"Covariate Unit Root Test for Cross-Sectionally Dependent Panel Data," Annual Conference of the African Econometric Society, カンパラ, 2012 年 7 月。

"Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," 2012 Hitotsubashi-Sogang Conference on Econometrics, 西江大学, 2012 年 11 月。

"Covariate Unit Root Test for Cross-Sectionally Dependent Panel Data," Asian Meeting of Econometric Society, デリー大学, 2012 年 12 月。

（b）国内研究プロジェクト

「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 – 2008 年度, 研究代表者

「社会科学の高度統計・実証分析拠点構築」グローバル COE プログラム（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）

「計量経済学におけるコンピュータ・インテンシブな統計手法の開発とその実証研究」文部科学省科学研究費補助金基盤研究（A），2011 – 2015 年度，研究分担者

「金融工学から ERM へ：基礎理論と実証に関する研究」文部科学省科学研究費補助金基盤研究（A），2012 – 2015 年度，研究分担者

（c）国際研究プロジェクト

「マクロ・パネル・データの計量経済分析手法の開発」日本学術振興会・二国間交流事業共同研究（英国（BA）との共同研究），2011－2012 年度，研究代表者

「一橋－西江大学　計量経済学コンファレンス 2012」日本学術振興会・二国間交流事業共同セミナー（韓国（NRF）との共同セミナー），2012 年度，研究代表者

（d）研究集会オーガナイズ

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，2008 年 9 月 30 日，一橋大学

国際交流セミナー，2010 年 11 月 19 日，一橋大学

"Hitotsubashi Conference on Econometrics 2010," 2010 年 11 月 20 – 21 日，一橋大学

国際交流セミナー，2011 年 12 月 8 日，一橋大学

国際交流セミナー，2012 年 6 月 4 日，一橋大学

「一橋－西江大学　計量経済学コンファレンス 2012」2012 年 11 月 17 日，西江大学

"Hitotsubashi Conference on Econometrics 2013（関西計量経済研究会），" 2013 年 1 月 12 – 13 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

教育力開発プロジェクト（2007 年 4 月 – 2009 年 3 月）

全学アプリケーション検討専門員会（2007 年 11 月 – ）

評価委員会（研究科内）（2007 年 12 月 – 2011 年 3 月）

FD 委員会（研究科内）（2007 年 12 月 – 2011 年 3 月）

人事連絡委員会（研究科内）（2008 年 4 月 – 2010 年 9 月）

教育システム委員会（研究科内）（2009 年 4 月 – ）

情報処理・教育システム仕様策定委員会（2009 年 10 月 – 2011 年 3 月）

経済学研究科中長期構想委員会（研究科内）（2009 年 12 月 – ）

学部教育専門委員会（2010 年 4 月 – 2012 年 3 月）

5 年一貫教育運営委員会（研究科内）（2010 年 4 月 – 2011 年 3 月）

人事委員会（研究科内）（2010 年 10 月 – ）

学生国際交流専門委員会（2011 年 4 月 － 2012 年 3 月）
オープンキャンパス実施専門委員会（2011 年 4 月 － 2012 年 3 月）
学生支援センター運営協議会（2011 年 4 月 － 2012 年 3 月）
臨時入試幹事（研究科内）（2011 年 4 月 － 2012 年 3 月）
入学試験実施専門委員会電算部会（2012 年 4 月 － 2013 年 3 月）

7. 学外活動

（a）他大学講師等

京都大学経済研究所非常勤講師（2010 － 2011 年度）

（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（2012 年度春季大会プログラム委員）
Econometric Society
Journal of the Japan Statistical Society（編集委員： 2010 年 9 月 － ）
統計学会連合（連合大会プログラム委員： 2012 年 9 月 － 2014 年 9 月）
Journal of Time Series Analysis（Associate Editor： 2013 年 1 月 － ）

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。
「研究室訪問」，HQ2013 年冬号（Vol.37）。
「なぜ，統計学を学ぶのか？」，『教養としての経済学　生き抜く力を培うために』（一橋大学経済学部編），2013 年 2 月。