ふりがな　　やまもと　ようへい

氏　名　　**山本　庸平**

1. 学歴

1997 年　3 月　東京大学経済学部経済学科卒業

2003 年　9 月　ボストン大学経済学大学院博士課程入学

2009 年　5 月　同修了(Ph.D. in Economics)

2. 職歴･研究歴

1997 年　4 月　日本政策投資銀行（2006 年 7 月まで）

2009 年　7 月　アルバータ州立大学ビジネススクール助教授（2012 年 3 月まで）

2012 年　4 月　一橋大学大学院経済学研究科専任講師

3. 学内教育活動

A. 担当講義名

（b）大学院

上級計量経済学Ⅰ，中級計量経済学

B. ゼミナール

大学院

C. 講義およびゼミナールの指導方針

中級計量経済学では，計量経済学が必ずしも専門でない学生を対象として基礎的な理論をなるべく直感的にわかるように講義し，計算機演習と宿題を通じて実際の問題を正確に分析できるようにする。上級計量経済学Ⅰでは，計量経済学の学術論文や大学院上級の教科書を理解するために，質量ともに欧米の経済学大学院の Ph.D.コースと同レベルの授業を行う。

ゼミでは，以下の2つを目標とする。まず，ゼミに参加する学生全員が大学院上級レベルの計量経済理論や高度な応用実証分析の学術論文を理解し，実際に現実の経済問題に応用できるようになること。次に，研究者志望の学生については既存の理論が現実の経済問題に適用困難であっても，自分なりに新たな推定や検定の方法を構築できるようになること。

4. 主な研究テーマ

計量経済理論とその応用分析を行っている。

（1）パラメータの構造変化の推論にかかる諸問題とその応用

　（a）線形モデルにおける複数構造変化（multiple structural changes）

　（b）構造変化検定に付随する棄却力低下の問題

（2）動学的ファクターモデルなど長期にわたるパネルデータなど大規模なデータセットの分析手法

　（a）動学的ファクターモデルの識別問題と安定性

　（b）可変パラメータモデル分析

5. 研究活動

A. 業績

（b）論文（査読つき論文には*）

* "A Note on Estimating and Testing for Multiple Structural Changes in Models with Endogenous Regressors via 2SLS" (joint with Pierre Perron), November 2012, forthcoming in *Econometric Theory*

* "Using OLS to Estimate and Test for Structural Changes in Models with Endogenous Regressors" (joint with Pierre Perron), November 2012, forthcoming in *Journal of Applied Econometrics*

（d）その他

"Estimating and Testing Multiple Structural Changes in Linear Models by Band Spectral Regressions" (joint with Pierre Perron), October 2012, Global COE Hi-Stat DP No. 250

"Bootstrap inference of Impulse Response Functions in Factor-Augmented Vector Autoregressions," October 2012, Global COE Hi-Stat DP No. 249

"Does Foreign Exchange Intervention Volume Matter?" (joint with Rasmus Fatum), May 2012, Globalization and Monetary Policy Institute Working Paper 115, Federal Reserve Bank of Dallas

"On the Usefulness or Lack Thereof of Optimality Criteria for Structural Change Tests" (joint with Pierre Perron), May 2012, Global COE Hi-Stat DP No. 258

"Time Instability of the US Monetary System: Multiple Break Tests and Reduced Rank TVP VAR" (joint with Dukpa Kim), January 2012, Working Paper, University of Virginia

"Forecasting with Non-spurious Factors in U.S. Macroeconomic Time Series," February 2013, Global COE Hi-Stat DP No. 280

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*）

"Bootstrap inference of Impulse Response Functions in Factor-Augmented Vector Autoregressions," Canadian Econometric Study Group Meeting,（カナダ, 2010 年 10 月）

"Using OLS to Estimate and Test for Structural Changes in Models with Endogenous Regressors," 名古屋マクロ公共経済コンファレンス,（名古屋大学, 2010 年 12 月）

"Using OLS to Estimate and Test for Structural Changes in Models with Endogenous Regressors," マクロ計量コンファレンス,（一橋大学, 2011 年 2 月）

"Bootstrap inference of Impulse Response Functions in Factor-Augmented Vector Autoregressions," The 5th CIREQ Time Series Conference,（カナダ, 2011 年 5 月）

"Bootstrap inference of Impulse Response Functions in Factor-Augmented Vector Autoregressions," 2011 North American Summer Meeting of Econometric Society, St. Louise MO,（アメリカ, 2011 年 6 月）

"Estimating and Testing Multiple Structural Changes in Linear Models by Band Spectral Regressions," Canadian Econometric Study Group Meeting,（カナダ, 2011 年 10 月）

* "Bootstrap inference of Impulse Response Functions in Factor-Augmented Vector Autoregressions," 日本応用経済学会春季大会推薦講演,（福岡大学, 2012 年 6 月）

"Time Instability of the US monetary system: Multiple Break Tests and Reduced Rank TVP VAR," The 11th World Meeting of the International Society for Bayesian Analysis,（京都, 2012 年 6 月）

"On the Usefulness or Lack Thereof of Optimality Criteria for Structural Change Tests," 2012 Hitotsubashi-Sogan Conference on Econometrics,（韓国, 2012 年 11 月）

"Forecasting with Non-spurious Factors in U.S. Macroeconomic Time Series," 関西計量経済学研究会,（一橋大学, 2013 年 1 月）

"Forecasting with Non-spurious Factors in U.S. Macroeconomic Time Series," マクロ計量国際コンファレンス,（一橋大学, 2013 年 3 月）

（b）国内研究プロジェクト

「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 年度 - 2015 年度, 研究分担者

6. 学内外活動

（b）学内委員会

入学試験管理委員会委員（2012 年度）

7. 学外活動

（b）所属学会および学術活動

Econometric Society
日本経済学会
日本統計学会
日本応用経済学会