

---

## 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 ポ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  
2014年 10月 シンガポール国立大学にて在外研究(2014年11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, 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。

『経済時系列分析ハンドブック』(「非定常時系列分析」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 Prebisch-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.
- "Estimation and Inference in Predictive Regressions," (with Kohei Aono), *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.54, No.2, December 2013, pp.231-250,.
- \* 「レベル・シフトの検定と検出力の非単調性」(山崎大輔氏との共著)『日本統計学会誌(シリーズ J)』, Vol.4, No.1, 2014 年 9 月, pp.61-74.
- \* "Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," *Journal of Time Series Econometrics*, 2014 (forthcoming).
- \* "Synergy Between an Improved Covariate Unit Root Test and Cross-sectionally Dependent Panel Data Unit Root Tests," (with Kaddour Hadri and Daisuke Yamazaki), *Manchester School*, 2014 (forthcoming).

\* "Testing for Parameter Constancy in the Time Series Direction in Panel Data Models," (with Daisuke Yamazaki), *Journal of Statistical Computation and Simulation*, 2014 (forthcoming).

#### (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.

"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.

"Novel Panel Cointegration Tests Emending for Cross-Section Dependence with N Fixed," (with Kaddour Hadri and Yao Rao), Discussion Paper #2013-12, Graduate School of Economics, Hitotsubashi University, 2013.

"Improving the Finite Sample Performance of Tests for a Shift in Mean," (with Daisuke Yamazaki), Discussion Paper #2014-16, Graduate School of Economics, Hitotsubashi University, November 2014.

"Confidence Sets for the Break Date Based on Optimal Tests," (with Yohei Yamamoto), Discussion Paper #2015-01, Graduate School of Economics, Hitotsubashi University, January 2015.

### 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\*)

"Estimation and Inference in Predictive Regressions," 関西計量経済学研究会, 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," 関西計量経済学研究会, 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。

"Testing for Parameter Constancy in the Time-Series Direction in Fixed-Effect Panel Data Models," EEA-ESEM Meeting 2013, the University of Gothenberg, Sweden, 2013年8月26日。

\*"Information Criteria and Model Selection," 2013年度関西計量経済学研究会, 京都大学, 2014年1月11日。

\*「経済時系列分析と構造変化」, 応用経済時系列研究会チュートリアル・セミナー, 千葉商科大学丸の内サテライトキャンパス, 2014年2月21日。

"Novel Panel Cointegration Tests Emending for Cross-Section Dependence with N Fixed," Asian Meeting of Econometric Society, Academia Sinica, Taiwan, 2014年6月22日。

"Improving the Finite Sample Performance of Tests for a Shift in Mean," The Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics, Queen Mary University of London, UK, 2014年6月26日。

"Confidence Set for the Break Date Based on an Optimal Test," 2014年度関西計量経済学研究会, 大阪大学, 2015年1月10日。

### **(b) 国内研究プロジェクト**

「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

「金融資産収益率の予測および購買力平価仮説の検証」公益財団法人清明会研究助成金, 2012年12月 - 2013年12月

「大規模パネル・データ・モデルの統計的分析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(B), 2013 - 2015 年度, 研究代表者

### **(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, 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

国際交流セミナー, 2013年7月5日, 一橋大学

「一橋 - 西江大学 計量経済学コンファレンス 2014」2014年12月13日, 西江大学

## 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

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 - 2012 年 3 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)  
全学共通教育開発プロジェクト(2013 年 4 月 - 2015 年 3 月)

### (c) 課外活動顧問

体育会ホッケー部長

---

## 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)  
日本銀行理論研修講師(2014 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, 英文誌編集委員: 2010 年 9 月 - , 連合大会プログラム委員: 2012 年 9 月 - 2014 年 9 月, 代議員: 2015 - 2016 年度)  
日本経済学会(2012 年度春季大会プログラム委員)  
Econometric Society  
International Association for Applied Econometrics  
Journal of Time Series Analysis (Associate Editor: 2013 年 1 月 - )

### (c) 公開講座・開放講座

「なぜ、統計学を学ぶのか？」(平成 26 年度一橋大学春季公開講座, 2014 年 5 月 24 日, 一橋大学国立西キャンパス)

---

## 9. 一般的言論活動

「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。

「平成 26 年度一橋大学春季公開講座『教養としての経済学』もう一歩先へ—生き抜く力を培うために」(一部執筆), HQ2014 年秋号(Vol.44)。