
1. 学歴

2004年 3月 東京大学経済学部卒業
2004年 4月 東京大学大学院経済学研究科修士課程入学
2006年 3月 東京大学大学院経済学研究科修士課程修了
2012年 5月 メリーランド大学 博士号取得(Ph.D, 経済学)

2. 職歴・研究歴

2011年 8月 International Monetary Fund, Intern
2012年 1月 University College London, Post-Doctoral Research Associates
2013年 10月 一橋大学経済学部常勤講師

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, 中級計量ファイナンス

(b) 大学院

中級計量ファイナンス, 計量ファイナンス特論(マーケット・マイクロストラクチャー)

C. 講義およびゼミナールの指導方針

中級計量ファイナンスにおいては、講義および計算機演習による計量手法の運用を通じて、ファイナンスの実証分析において頻用される手法を学ぶことを目的とする。特論においては株式・外国為替等の市場構造・取引システム・価格形成について、理論・実証双方の面から授業を行う。

4. 主な研究テーマ

日中の取引データを用いたファイナンスの実証分析を主に行っている。特に

- (1) 流動性・注文行動の予測可能性
- (2) 異なる市場間における注文・価格形成過程の相関についての分析
- (3) 高頻度取引の注文行動と市場への影響

に着目している。

5. 研究活動

A. 業績

(a) 著書・編著

政府の大きさと社会保障制度, 東京大学出版会, 2007. 第7章「家計の行動と公共政策の効果—構造パラメータの検証と推定」(共著者: 畑農鋭矢)

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*)

- 2011, 2010 University of Maryland College Park, Finance department brown bag seminar
- 2011 Econometric Society Asian meeting at Korea University
- 2011 Asian Finance Association annual meeting at University of Macau
- 2011 日本ファイナンス学会(早稲田大学)
- 2012 University College London Finance workshop
- 2012 日本ファイナンス学会(一橋大学)
- * 2012 大阪大学 CSFI seminar
- 2013 日本ファイナンス学会(武蔵大学)
- * 2013 大阪大学
- * 2013 横浜国立大学
- * 2014 CFEE 第二回研究集会(一橋大学)
- * 2014 大阪証券取引所寄付研究部門ワークショップ 証券市場の諸問題
- 2014 Financial Management Association Annual Meeting (Nashville)

(b) 国内研究プロジェクト

日本取引所(JPX)-東京大学 高頻度取引に関する共同研究

7. 学外活動

(b) 所属学会および学術活動

日本ファイナンス学会

Financial Management Association