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
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，リーダーシップ開発，統計学

（b）大学院

上級計量経済学，中級計量経済学，特別講義（金融工学とリスクマネジメント），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。

(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。

『統計学 改訂版』(森棟公夫, 照井伸彦, 中川満, 西埜晴久, 黒住英司著), 有斐閣, 2015 年, 486 頁。

『計量経済学』(黒住英司著), 東洋経済, 2016 年 3 月, 241 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*, 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）』, 第 38 巻, 第 1 号, 2008 年 9 月, 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.

"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）』, 第 44 巻, 第 1 号, 2014 年 9 月, 61-74 頁。

* "Testing for Multiple Structural Changes with Non-Homogeneous Regressors," *Journal of Time Series Econometrics*, Vol.7, No.1, January 2015, pp.1-35.

* "Testing for Parameter Constancy in the Time Series Direction in Panel Data Models," (with Daisuke Yamazaki), *Journal of Statistical Computation and Simulation*, Vol.85, Issue 14, September 2015, pp.2874-2902.

* "Novel Panel Cointegration Tests Emending for Cross-Section Dependence with N Fixed," (with Kaddour Hadri and Yao Rao), *Econometrics Journal*, Vol.18, October 2015, pp.363-411.

* "Confidence Sets for the Break Date Based on Optimal Tests," (with Yohei Yamamoto), *Econometrics Journal*, Vol.18, October 2015, pp.412-435.

* "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*, Vol.83, No.6, December 2015, pp.676-700.

* "Improving the Finite Sample Performance of Tests for a Shift in Mean," (with Daisuke Yamazaki), *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol.167, December 2015, pp.144-173.

*「非斉次な説明変数を持つ回帰モデルにおける構造変化点の信頼領域の構築」『日本統計学会誌（シリーズJ）』, 第 46 巻, 第 1 号, 2016 年 9 月, 69-84 頁。

* "Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors," *Journal of Time Series Analysis*, Vol.38, September 2017, pp.791-805.

* "Confidence Sets for the Break Date in Cointegrating Regressions," (with Anton Skrobotov), Oxford Bulletin of Economics and Statistics, Vol.80, June 2018, pp.514-535.

* "Confidence Sets for the Date of a Structural Change at the End of a Sample," *Journal of Time Series Analysis*, Vol.39, November 2018, pp.850-862.

* "Power Properties of the Modified CUSUM Tests," (with Peiyun Jiang), *Communications in Statistics - Theory and Methods*, November 2018 (online; https://doi.org/10.1080/03610926.2018.1473598).

（c）翻訳

T.S.ラオ ・S.S.ラオ ・C.R.ラオ 編『時系列分析ハンドブック』（「非線形・非定常時系列のモデリング」担当），（北川源四郎，田中勝人，川崎能典監訳），朝倉書店，2016。

（d）その他

"The ET Interview: Professor Katsuto Tanaka," (with In Choi), *Econometric Theory*, Vol.30, No.2, April 2014, pp.474-490.

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*）

"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。

"Confidence Set for the Break Date Based on Optimal Tests," The 2nd Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics, Grand Hotel Palace, Greece, 2015 年 6 月 27 日。

*「経済データの構造変化の検定」, 統計関連学会連合大会, 岡山大学, 2015 年 9 月 8 日。

"Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors," 2015 年度関西計量経済学研究会, 東京大学, 2016 年 1 月 9 日。

"Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors," 12th International Symposium on Econometric Theory and Applications, the University of Waikato, New Zealand, 2016 年 2 月 19 日。

"Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors," The 3rd Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics, University of Milano-Bicocca, Italy, 2016 年 6 月 22 日。

*"Confidence Sets for the Break Date in Cointegrating Regressions," 2016 Japan-Korea Allied Conference in Econometrics, 一橋大学, 2016 年 11 月 19 日。

*"Monitoring Parameter Constancy with Endogenous Regressors," Hiroshima Conference on Statistical Science 2016, 広島大学, 2016 年 12 月 17 日。

"Confidence Sets for the Date of a Mean Shift at the End of a Sample," 2017 年度関西計量経済学研究会, 神戸大学, 2018 年 1 月 6 日。

"Confidence Sets for the Date of a Structural Change at the End of a Sample," The 5th Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics, Université du Québec à Montréal and Université de Montréal, Canada, 2018 年 6 月 29 日。

*"Monitoring Tests for Bubbles," Recent Developments in Econometric Theory and Applications, Sogang University, Korea, 2018 年 12 月 11 日。

（b）国内研究プロジェクト

「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

「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

「経済データのモニタリング検定の理論の開発と応用」文部科学省科学研究費補助金基盤研究（C）, 2016 – 2018 年度, 研究代表者

（d）研究集会オーガナイズ

"The 11th International Symposium on Econometric Theory and Applications (SETA 2015)," 2015 年 5 月 30 – 31 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2015 年 7 月 30 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2016 年 6 月 2 日, 一橋大学

"2016 Japan-Korea Allied Conference in Econometrics," 2016 年 11 月 19 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2017 年 5 月 6 日, 一橋大学

国際交流セミナー, 2017 年 10 月 20 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

第 9 回日本統計学会研究業績賞，日本統計学会，2015 年

6. 学内行政

（a）役員・部局長・評議員等

教育研究評議員（2016 年 4 月 – 2018 年 3 月）

（b）学内委員会

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

クラス顧問（2017 年 4 月 – 2019 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

日本銀行理論研修講師（2014 – 2015 年度）

東京外国語大学国際社会学部非常勤講師（2016 – 2018 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 – ）

Hitotsubashi Journal of Economics（Editorial Board: 2015 年 10 月 – ）

Japanese Journal of Statistics and Data Science（Associate Editor： 2017 年 9 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）

（d）高校生向けの出張講義・模擬講義

模擬講義（千葉県立船橋高等学校） 2015 年 10 月 29 日

模擬講義（福岡県立筑紫丘高等学校，講義は一橋大学内） 2017 年 8 月 3 日

模擬講義（青森県立青森高等学校） 2018 年 6 月 14 日

（e）その他（公的機関･各種団体･民間企業等における講演等）

日本学術振興会科学研究費委員会専門委員（2013 年 12 月 － 2015 年 11 月）

統計検定問題策定委員会　統計検定 2 級（委員長：2016 年 1 月 －12 月，副委員長：2015 年 2 月 －12 月，2017 年 1 月 － 12 月）

9. 一般的言論活動

「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）。