

---

## 1. 学歴

- 1993年 3月 東京大学教養学部 卒業  
1993年 4月 東京大学大学院総合文化研究科修士課程 入学  
1995年 3月 同修了  
1995年 4月 同博士課程 入学  
1996年 9月 イェール大学大学院経済学部博士課程 入学  
2000年 12月 同修了(Ph. D. in Economics)

---

## 2. 職歴・研究歴

- 2000年 9月 エセックス大学経済学部講師  
2002年 1月 イェール大学経済学部客員研究員(2003年6月まで)  
2003年 7月 クイーンズ大学経済学部助教授  
2008年 7月 クイーンズ大学経済学部准教授  
2009年 4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

#### (b) 大学院

上級計量経済学 , 計量経済学特論, 統計学入門

### 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

学部ゼミでは, 数理統計学・計量経済学の基礎理論を習得した上で, 計量経済学の手法を学び, 実証分析に応用するノウハウを身につけることを目標としている。

大学院の講義・ゼミにおいては, 数理統計学・計量経済学の方法論を理解した上で, 経済学との接点を視野においた独自の研究ができるようになることを目標としている。

---

## 4. 主な研究テーマ

統計学および計量経済学の方法論の研究を行っている。最近の研究テーマは以下の通りである。

- a) estimation of dynamic structural econometric models
- b) identification and estimation of finite mixture models
- c) estimation and inference in long-memory processes

## 5. 研究活動

### A. 業績

#### (b) 論文(査読つき論文には\*)

- \* "Pooled Log Periodogram Regression," with Peter C.B. Phillips, *Journal of Time Series Analysis* 23(1), January 2002, pp. 57-93.
- \* "Local Whittle Estimation in Nonstationary and Unit Root Cases," with Peter C.B. Phillips, *Annals of Statistics* 32(2), April 2004, pp. 656-692.
- \* "Exact Local Whittle Estimation of Fractional Integration," with Peter C.B. Phillips, *Annals of Statistics* 33(4), August 2005, pp. 1890-1933.
- \* "Local Whittle Estimation of Fractional Integration and Some of its Variants," with Peter C.B. Phillips, *Journal of Econometrics* 103(2), February 2006, pp. 209-233.
- \* "Gaussian Semiparametric Estimation of Multivariate Fractionally Integrated Processes," *Journal of Econometrics* 137(2), April 2007, pp. 277-310.
- \* "Determining the Cointegrating Rank in Nonstationary Fractional Systems by the Exact Local Whittle Approach," with Morten Ø. Nielsen, *Journal of Econometrics* 141(2), December 2007, pp. 574-596.
- \* "Pseudo-likelihood Estimation and Bootstrap Inference for Structural Discrete Markov Decision Models," with Hiroyuki Kasahara, *Journal of Econometrics* 146(1), September 2008, pp. 92-106.
- \* "Nonparametric Identification of Finite Mixture Models of Dynamic Discrete Choices," with Hiroyuki Kasahara, *Econometrica* 77(1), January 2009, pp. 135-175.
- \* "Covariance-based Orthogonality Tests for Regressors with Unknown Persistence," with Alex Maynard, *Econometric Theory* 25(1), January 2009, pp. 63-116.
- \* "Improvement in Finite Sample Properties of the Hansen-Jagannathan Distance Test," with Yu Ren, *Journal of Empirical Finance* 16(3), June 2009, pp. 483-506.
- \* "Exact Local Whittle Estimation of Fractional Integration with Unknown Mean and Time Trend," *Econometric Theory* 26(2), April 2010, pp. 501-540.
- \* "Decline in the persistence of real exchange rates, but not sufficient for purchasing power parity," with Tatsuyoshi Okimoto, *Journal of the Japanese and International Economies* 24(3), September 2010, pp. 395-411.
- \* "Empirical Likelihood Block Bootstrapping," with Jason Allen and Allan W. Gregory. Forthcoming in *Journal of Econometrics*, March 2010.

### 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\*)

- "Nonparametric Identification of Finite Mixture Models of Dynamic Discrete Choices," Econometric Society Far Eastern Meetings, Taipei, 2007年7月
- "Sequential Estimation of Structural Models with a Fixed Point Constraint," Econometric Society Far Eastern Meetings, Singapore, 2008年7月
- "Sequential Estimation of Dynamic Programming Models," Econometric Society North American Summer Meeting, Boston, 2009年7月
- "Sequential Estimation of Structural Models with a Fixed Point Constraint," 2009 International Symposium on

Econometric Theory and Applications, Kyoto, 2009 年 8 月

"Sequential Estimation of Dynamic Programming Models," Econometric Society Far Eastern Meetings, Tokyo, 2009 年 8 月

"Nonparametric Identification of Multivariate Mixtures," 2010 Tsinghua Econometrics Conference in Beijing, 2010 年 5 月

"Sequential Estimation of Dynamic Programming Models," 日本経済学会 2010 年度秋季大会, 2010 年 6 月

"Nonparametric Identification of Multivariate Mixtures," Canadian Econometrics Study Group Conference, Vancouver, 2010 年 10 月

\* "Sequential Estimation of Structural Models with a Fixed Point Constraint," 第 13 回情報論的学習理論ワークショップ, 2010 年 11 月

#### (d) 研究集会オーガナイズ

Program Committee member, Canadian Econometrics Study Group Conference, Niagara Falls, Canada, 2006 年 6 月

Program Committee member, CIRANO-CIREQ Time Series Conference, Montreal, Canada, 2006 年 12 月

Program Committee member, Canadian Econometrics Study Group Conference, 2009 年 9 月

Program Committee member, 2010 International Symposium on Econometric Theory and Applications, 2010 年 4 月

Program Committee member, Hitotsubashi Conference on Econometrics 2010, 2010 年 11 月

### C. 受賞

2010 Arnold Zellner award for the most significant theoretical paper published in the *Journal of Econometrics* in 2008 and 2009. ("Pseudo-likelihood Estimation and Bootstrap Inference for Structural Discrete Markov Decision Models," with Hiroyuki Kasahara, *Journal of Econometrics* 146(1), September 2008, pp. 92-106. に対して)

---

## 6. 学内行政

### (b) 学内委員会

大学院臨時入試幹事(研究科内)(2010 年 4 月 - )

人事委員会(研究科内)(2010 年 8 月 - )

---

## 7. 学外活動

### (b) 所属学会および学術活動

日本経済学会

日本統計学会

Econometric Society

Institute of Mathematical Statistics