

1. 学歴

- 1968年 3月 慶応義塾大学工学部管理工学科卒業
1968年 4月 慶応義塾大学工学研究科修士課程管理工学専攻入学
1970年 3月 同修了
1970年 4月 慶応義塾大学工学研究科博士課程管理工学専攻入学
1970年 9月 ペンシルヴァニア大学大学院経済学研究科博士課程入学
1974年 8月 同修了 (Ph.D. in Economics)
1976年 3月 慶応義塾大学工学研究科博士課程管理工学専攻退学

2. 職歴・研究歴

- 1974年 10月 ルーヴァン・カソリック大学附属 Center for Operations Research and Econometrics (CORE) 研究員 (Post-Doctoral Research Fellow)
1976年 4月 創価大学経済学部専任講師
1978年 4月 創価大学経済学部助教授
1981年 5月 スタンフォード大学において長期在外研究 (1982年1月まで)
1982年 4月 横浜国立大学経済学部助教授
1987年 4月 横浜国立大学経済学部教授
1988年 4月 筑波大学社会工学系教授
1991年 4月 一橋大学経済学部教授
1998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

(a) 学部学生向け

統計学入門, 基礎計量経済学, 数量経済分析 A

(b) 大学院

中級計量経済学, 上級計量経済学, 上級計量経済学, 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

数量経済分析 A は, 大学院での計量経済学を学ぶための線形代数, 確率論, 統計学の準備科目であり, 基礎として重要なので, 基礎的な考え方の修得を目指した講義を心がけている。中級計量は, 基礎的な計量経済学理論の修得を目指しているが, 実際にその手法を使えるようになることも重要なので, TSP などを用いた実習ならびに実証

レポートの課題も与えている。他の科目については紙数の制約のため省略。

学部のゼミは、3 年次は計量経済学、時系列分析のテキストに従い、輪読形式で考え方の基礎を学び、4 年次からは、各自が興味を持つ問題について実証分析を学んで、卒論につなげていく。大学院のゼミについては、修士 1 年次に時系列分析のテキストを輪読し、時系列分析の基礎を学び、2 年次には、各自が興味を持つ時系列・計量理論あるいは実証論文の輪読を行い、修論に取り組む。博士ゼミは、参加者が興味のある最先端の論文を順番に取り上げ、輪読形式で報告・討論をする。最近パネル・データ分析を取り上げている。

4. 主な研究テーマ

- (1) 時系列分析の理論
- (2) 計量経済学の理論
- (3) 日本経済の実証分析

時系列分析の理論を主たる研究テーマとしている。当初は時系列モデルを用いて予測を行った時の予測誤差の評価が主たる興味の対象であった。研究業績の欄に示した "Properties of Predictors in Misspecified Autoregressive Time Series Models," (with Naoto Kunitomo) *Journal of the American Statistical Association*, 1985 等がそれにあたる。1990 年以降は非定常時系列モデルの推定方法、検定方法の開発に関心を持ち、"Statistical Inference in Vector Autoregressions with Possibly Integrated Processes," (with Hiroyuki Toda) *Journal of Econometrics*, 1995, "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," (with Eiji Kurozumi), *Journal of Time Series Analysis*, 2006 等を著した。最近では、パネル・データの計量分析 (特に動学的パネル・モデルの計量理論) に関心を持っている。

5. 研究活動

A. 業績

(a) 著書・編著

『計量経済学』(単著) 創価大学通信教育部, 1979 年, 284 頁。

『経済の時系列分析』(単著) 創文社, 1988 年, 352 頁。

『計量経済学』(単著) 新世社, 1995 年, 362 頁。

(b) 論文(査読つき論文には*)

* "Asymptotic Mean Square Prediction Error for an Autoregressive Model with Estimated Coefficients," *Journal of the Royal Statistical Society, Series C (Applied Statistics)*, Vol.25, No.2, 1976, pp.123-127.

"A Note on the Choice of the Simplified Estimator for Geometric Distributed Lag Models with Autoregressive Errors," *Soka Economic Studies*, Vol.6, No.2, 1976, pp.91-98.

"Sampling Experiments of Predictive Ability: Comparison of Alternative Single Equation Estimators for Simultaneous Equation Models," *Soka Economic Studies*, Vol.6, No.4, 1977, pp.99-130.

* "A Note on the Use of Two-Step Aitken Methods in Inappropriate Situations," *Economic Studies Quarterly*, Vol.28, No.1, 1977, pp.78-85.

"Notes on Money, Income, and Causality," *Soka Economic Studies*, Vol.7, No.1, 1977, pp.113-117.

「ARMA モデルにおける多期間予測の漸近平均自乗誤差」『創価経済論集』第 7 巻 3 号, 1977 年, 81-92 頁。

* 「対ドル円レートの四半期予測モデル」『日本経済研究』第 8 号, 1979 年, 2-18 頁。

* "On the Prediction Efficiency of the Generalized Least Squares Model with an Estimated Variance Covariance

- Matrix," *International Economic Review*, Vol.20, No.3, 1979, pp.693-705.
- 「動学モデルの予測について」『創価経済論集』第9巻3号, 1979年, 59-70頁。
- * "On the Treatment of Autocorrelated Errors in the Multiperiod Prediction of Dynamic Simultaneous Equation Models," *International Economic Review*, Vol.21, No.3, 1980, pp.735-748.
- "Prediction Error of Parametric Time-Series Models with Estimated Coefficients," *Soka Economic Studies*, Vol.10, No.2, 1981, pp.303-313.
- * "A Note on the Effect of Misspecification and Temporal Aggregation in the GLS Model," *Economic Studies Quarterly*, Vol.32, No.1, 1981, pp.77-82.
- * "Predictions of Multivariate Autoregressive-Moving Average Models," *Biometrika*, Vol.68, No.2, 1981, pp.485-492.
- 「人員・労働時間タームでの雇用調整の実証分析」『三田学会雑誌』第75巻1号, 1982年, 65-91頁。
- 「時系列分析とマクロ経済学」貝塚・浜田・藪下編『マクロ経済学と経済政策』東大出版会, 1983年, 79-108頁。
- * "Asymptotic Bias of the Least Squares Estimator for Multivariate Autoregressive Models," (with Naoto Kunitomo) *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*, Vol.36, No.3, 1984, pp.419-430.
- "Shrunken Predictors for Autoregressive Models," *Economia*, No.86, 1985, pp.71-103.
- * "Properties of Predictors in Misspecified Autoregressive Time Series Models," (with Naoto Kunitomo) *Journal of the American Statistical Association*, Vol.80, No.392, 1985, pp.941-950.
- 「多変量時系列における因果序列と仮説検定及びマクロ計量分析への応用(1)」(国友直人氏との共同論文)『経済学論集』第51巻4号, 1986年, 15-27頁。
- 「多変量時系列における因果序列と仮説検定及びマクロ計量分析への応用(2)」(国友直人氏との共同論文)『経済学論集』第52巻1号, 1986年, 30-50頁。
- "Improving the Prediction of Autoregressive Models," *Osaka Economic Papers*, No.36, pp.7-13.
- 「外国為替市場における効率性について-時系列解析によるアプローチ」(竹内恵行氏との共同論文)『経済研究』第38巻2号, 1987年, 97-109頁。
- * "Conditions on Consistency for Testing Hypotheses under Rational Expectation by Vector Autoregressive Models and Cointegration," (with Naoto Kunitomo) *Economic Studies Quarterly*, Vol.41, No.1, 1990, pp.15-33.
- 「マーケット・モデルにおけるシステムティック・リスクの確率的変動」(小池拓自氏との共同論文)『経済研究』第41巻3号, 1990年, 228-240頁。
- 「VARモデル」刈屋武昭編『金融・証券計量分析の基礎と応用』, 東洋経済, 1990年, 77-97頁。
- 「時系列分析とその経済分析への応用」『フィナンシャル・レビュー』第23号, 1992年, 48-71頁。
- 「時系列分析」高橋一編『計量経済学』八千代出版, 1993年, 149-184頁。
- "Normal Test for a Unit Root in the Autoregressive Time Series Model," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.34, No.2, 1993, pp.147-164.
- * "Statistical Inference in Vector Autoregressions with Possibly Integrated Processes," (with Hiroyuki Toda) *Journal of Econometrics*, Vol.66, Nos.1&2, 1995, pp.225-250.
- 「日本経済の構造変化 時系列分析の新しい方法による試論」(Zhai Gou-hao 氏との共同論文) 倉沢資成, 浅子和美編『構造変化と企業行動』日本評論社, 1995年, 351-365頁。
- "Comments on Hiroyuki Kosaka's Dynamic Properties of TCER and Related Models," in L. R. Klein ed. *Symposium in Memory of Kei Mori*, World Scientific, 1995, pp.36-42.
- * "Estimation in Dynamic Regression with an Integrated Process," (with Koichi Maekawa, Michio Hatanaka, and Yoshiyuki Takeuchi) *Journal of Statistical Planning and Inference*, Vol.49, 1996, pp.279-303.

- "A Simple Approach to the Statistical Inference in Linear Time Series Models which may Have Some Unit Roots," *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.37, No.2, 1996, pp.87-100.
- "Bias Correction in Dynamic Models with Cointegrated Regressors," *Bulletin of the International Statistical Institute*, 51st Session, Istanbul 1997, pp.77-78.
- * "Modified Lag Augmented Vector Autoregressions," (with Eiji Kurozumi) *Econometric Reviews*, Vol.19, No.2, 2000, pp.207-231.
- * "Alternative Representation for Asymptotic Distribution of Impulse Responses in Cointegrated VAR Systems," (with Yoichi Arai) *Economics Letters*, Vol.67, 2000, pp.261-271.
- * "Finite Sample Properties of the Test for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated System," (with Eiji Kurozumi) *Proceedings of International Congress on Modelling and Simulation 2001*, Modelling and Simulation Society of Australia and New Zealand Inc., 2001, pp.1243-1248.
- "Finite Sample Properties of the Granger Non-Causality Test in Possibly Cointegrated System," (with Hiroaki Chigira) *Bulletin of the International Statistical Institute*, 54th Session Contributed Papers Volume LX Book 2, 2003, pp.666-667.
- * "Equivalence of Two Expressions of the Impact Matrix," (with Eiji Kurozumi and Hiroaki Chigira) *Econometric Theory*, Vol. 21, 2005, pp. 870-875.
- "Lag Augmentation in Regression Models with Possibly Integrated Regressors," (with Eiji Kurozumi) *Hitotsubashi Journal of Economics*, Vol.46, No.2, 2005, pp.159-175.
- 「経済における時系列分析：概観と展望」(日本統計学会会長就任講演) 『日本統計学会雑誌』 vol. 35, 2006, pp. 81-101.
- * "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," (with Eiji Kurozumi), *Journal of Time Series Analysis*, Vol. 27, No. 5, 2006, pp. 703-723.
- * "Finite Sample Modification of the Granger Non-Causality Test in Cointegrated Vector Autoregressions," (with Hiroaki Chigira), 2006, forthcoming in *Communications in Statistics, Theory and Methods*.
- "Cointegration, Integration, and Long-term Forecasting," (with Hiroaki Chigira) Discussion Paper No.148, Hi-Stat, Institute of Economic Research, Hitotsubashi University, March 2006.
- "Forecasting in Large Cointegrated Systems," (with Hiroaki Chigira) Discussion Paper No.169, Hi-Stat, Institute of Economic Research, Hitotsubashi University, June 2006.
- "A Bias Corrected Estimation for Dynamic Panel Models in Small Samples," (with Hiroaki Chigira), Discussion Paper No.177, Hi-Stat, Institute of Economic research Hitotsubashi University, July 2006.

(c) 翻訳

『時系列モデル入門』 A. C. ハーヴェイ著 (国友直人氏との共訳) 東大出版会, 1985年, 233頁。

B. 最近の研究活動

(a) 国内外学会発表

- "Finite Sample Properties of the Granger Non-Causality Test in Possibly Cointegrated System," the 54th Session of the International Statistical Institute, Berlin, August 2003.
- "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems," the 57th Meeting of International Atlantic Economic Society, Lisbon, Portugal, March 2004.

"A Bias Corrected Estimation for Dynamic Panel Models in Small Samples," 関西計量経済学研究会, 神戸,
2006年2月.

"Forecasting in Large Cointegrated Systems," (Invited lecture) International Conference on Quantitative Economics,
Jilin University, China, July 2006.

(b) 国内研究プロジェクト

「数理ファイナンスのための統計理論と時系列分析による検証」 文部科学省科学研究費補助金基盤研究(A)(2),
2002年度-2004年度, 研究代表者。

「パネル・データ分析の計量理論と実証分析」 学術振興会科学研究費補助金基盤研究(A), 2005年度-2007年度,
研究代表者。

「社会科学の統計分析拠点構築」 21世紀 COE プロジェクト (研究代表者: 斎藤修経済研究所教授), 2003年度
-2007年度, 研究分担者。

C. 受賞

日経経済図書文化賞 (『経済の時系列分析』に対して), 日本経済新聞社, 1988年

6. 学内行政

(a) 部所長・評議員等

評議員 (1995年4月-1997年3月)

経済学研究科長・学部長 (1999年4月-2001年3月)

(b) 学内委員会

開放講座委員会委員 (2001年4月-2003年3月)

セクシャル・ハラスメント対策委員会委員 (2002年4月-2004年3月)

予算委員会委員 (2003年4月-2004年3月)

7. 学外活動

(b) 参加学会及び学術活動

日本統計学会 (会長: 2005, 2006年, 理事長: 1996, 1997年度, 理事: 1982-1983年度, 1986, 1987年度, 評議員:
1982-1987年度, 1992, 1993年度, 1996-2001年度, 2004-2007年度)

日本経済学会 (常任理事: 1999-2001年度, 理事: 1996-1998年度, 2005-2007年度)

Econometric Society