

## 長倉 大輔

〒108-8345 東京都港区三田 2-15-45、慶應義塾大学経済学部、研究室棟.

Email: nagakura(at)keio.jp ("(at)" を "@" で置き換えて下さい).

個人 Web: <http://user.keio.ac.jp/~nagakura/jindex.html>

### 学歴

2007 年 8 月、博士(経済学)、ワシントン大学大学院シアトル校.  
 2001 年 3 月、修士(経済学)、横浜国立大学大学院国際社会科学研究所.  
 1999 年 3 月、学士(経済学)、横浜国立大学経済学部.

### 職歴

2016 年 4 月 – 現在、教授、慶應義塾大学経済学部  
 2011 年 4 月 – 2016 年 3 月、准教授、慶應義塾大学経済学部.  
 2010 年 4 月 – 2011 年 3 月、助教、早稲田大学大学院ファイナンス研究科.  
 2007 年 9 月 – 2010 年 3 月、リサーチエコノミスト、日本銀行金融研究所.  
 2015 年 4 月 – 2016 年 3 月、非常勤講師、早稲田大学政治経済学部.  
 2015 年 4 月 – 2015 年 9 月、2021 年 4 月 – 2023 年 3 月、非常勤講師、上智大学経済学部.  
 2011 年 10 月 – 2013 年 3 月、非常勤講師、早稲田大学大学院ファイナンス研究科.  
 2009 年 10 月 – 2012 年 3 月、非常勤講師、横浜国立大学経済学部.

### 研究分野

計量経済学、時系列分析、金融計量経済学.

### 研究

#### 査読付き学術論文(英文)

- [14] "Testing for Random Coefficient Autoregressive and Stochastic Unit Root Models", 2023, Vol. 27(1), 117-129, *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*.
- [13] "Computing Exact Score Vectors for Linear Gaussian State Space Models", 2021, 50(8), 2313-2326, *Communications in Statistics – Simulation and Computation*.
- [12] "Further Results on the vecd Operator and Its Applications", *Communications in Statistics – Theory and Methods*, 2020, 49(10), 2321-2338.
- [11] "On the Relationship between the Matrix Operators vech and vecd", *Communications in Statistics – Theory and Methods*, 2018, 47(3), 3252-3268.
- [10] "A State Space Approach to Estimating the Integrated Variance under the Existence of Market Microstructure Noise" (渡部敏明氏との共著), *Journal of Financial Econometrics*, 2015, 13(1), 45-82.
- [9] "Asymmetries in Government Bond Returns" (藤原一平氏、Lena Körber 氏との共著), *Journal of Banking and Finance*, 2013, 37(8), 3218-3226.
- [8] "Explicit Vector Expression of Exact Score for Time Series in State Space Form", *Statistical Methodology*, 2013, 13, 69-74.
- [7] "Spurious Regressions in Technical Trading" (新谷元嗣氏、藪友良氏との共著), *Journal of Econometrics*, 2012, 169(2), 301-309.
- [6] "Asymptotic Theory for Explosive Random Coefficient Autoregressive Models and Inconsistency of a Unit Root Test Against a Stochastic Unit Root Process", *Statistics and Probability Letters*, 2009, 79(24), 2476-2483.
- [5] "Testing the Sequential Logit Model against the Nested Logit Model" (小林正人氏との共著), *Japanese Economic Review*, 2009, 60(3), 345-361.
- [4] "Testing for Coefficient Stability of AR(1) Model When the Null is an Integrated or a Stationary Process", *Journal of Statistical Planning and Inference*, 2009, 139(8), 2731-2745.
- [3] "A Note on the Relationship Between the Information Matrix Test and a Score Test for Parameter Constancy", *Economics Bulletin*, 2008, 3(5), 1-7.
- [2] "A Note on the Two Assumptions of Standard Unobserved Components Models", *Economics Letters*, 2008, 100(1), 123-125.
- [1] "A Note on the Relationship of the Ordered and Sequential Probit Models to the Multinomial Probit Model", *Economics Bulletin*, 2004, 3(40), 1-7.

#### 査読付き学術論文(和文)

- [1] 「GARCH 型モデルと Realized Volatility を用いた TOPIX 日次リターンの非線形性の検証」、(渡部敏明氏との共著)、*日本統計学会誌*、第39巻シリーズJ第1号、pp.65-94、(2009年9月).

## 進行中/未公開の論文

- [9] "Implications of Two measures of Persistence for Correlation Between Permanent and Transitory Shocks in U.S. Real GDP" (Eric Zivot 氏との共著).
- [8] "Testing for a Unit Root against a Stochastic Unit Root Correlated with Error Term".
- [7] "State Space Method for the Quadratic Estimator of the Integrated Variance in the Presence of Market Microstructure Noise" (渡部敏明氏との共著).
- [6] "Comparison of Several Estimators with Less Finite Sample Biases for the Sum of AR Coefficients".
- [5] "A Plug-in Type Break Test for Trends with an Integrated or Stationary Noise Component".
- [4] "A Bootstrap Method for Autoregressive Process Possibly Containing A Unit Root".
- [3] "Bootstrap Bias Correction for Functions of the Integrated Variance".
- [2] 「Sieve Bootstrap 法の最近の展開」.
- [1] 「Trend-Cycle 分析の手法について」.

## 会議、大会での発表

- [20] The 16<sup>th</sup> International Symposium on Econometric Theory and Applications: SETA2022, (July, 2022)
- [19] 5<sup>th</sup> International Conference on Econometrics and Statistics (EcoSta 2022), (June, 2022).
- [18] 1<sup>st</sup> International Conference on Econometrics and Statistics (EcoSta 2017), (2017 年 6 月).
- [17] 3<sup>rd</sup> Institute of Mathematical Statistics Asia Pacific Rim Meeting (2014 年 6/7 月).
- [16] 7<sup>th</sup> CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics (2013 年 12 月).
- [15] The 2013 Annual Meeting of the Taiwan Mathematical Society (2013 年 12 月)
- [14] 3<sup>rd</sup> International Conference, "High-Frequency Data Analysis in Financial Markets" (2012 年 11 月).
- [13] 2<sup>nd</sup> International Conference, "High-Frequency Data Analysis in Financial Markets" (2011 年 10 月).
- [12] 2010 年度統計関連学会連合大会 (2010 年 9 月).
- [11] 2009 Far East and South Asia Meeting of the Econometric Society (2009 年 8 月).
- [10] 43<sup>rd</sup> Annual Meeting of the Canadian Economic Association (2009 年 3 月).
- [9] International Conference on Econometrics and World Economy (2009 年 3 月).
- [8] Conference on Recent Developments in Finance and Econometrics (2009 年 2 月).
- [7] International Conference, "High-Frequency Data Analysis in Financial Markets" (2008 年 10 月).
- [6] 日本経済学会 2008 年秋季大会 (2008 年 9 月).
- [5] 日本経済学会 2008 年春季大会 (2008 年 5 月).
- [4] Hitotsubashi Conference on Econometrics 2007 (2007 年 11 月).
- [3] 76<sup>th</sup> Annual Meeting of the Southern Economic Association (2006 年 11 月).
- [2] 40<sup>th</sup> Annual Meeting of the Canadian Economic Association (2006 年 5 月).
- [1] Pennsylvania Economics Association 2006 Conference (2006 年 5 月).

## セミナー、ワークショップでの発表

- [34] 慶應義塾大学、経済研究所 (2019 年 12 月)
- [33] 慶應義塾大学、経済研究所 (2019 年 6 月)
- [32] 釧路公立大学 (研究集会「ファイナンス・経済統計の諸問題」) (2018 年 2 月)
- [31] 一橋大学 (研究集会「高頻度データを用いた資産価格の計量分析」) (2018 年 2 月)
- [30] 首都大学東京 (TMU Workshop on Financial Mathematics and Statistics 2016) (2016 年 11 月)
- [29] 東京理科大学 (第 7 回時系列分析と金融工学のセミナー) (2016 年 3 月).
- [28] 大阪大学 (2015 年度中之島ワークショップ) (2015 年 12 月).
- [27] 一橋大学 Summer Institute ワークショップ (Frontiers in Financial Econometrics) (2015 年 8 月)
- [26] 東京理科大学 (第 6 回時系列分析と金融工学のセミナー) (2015 年 3 月).
- [25] 一橋大学、経済学部 (2014 年 6 月)
- [24] 一橋大学、経済研究所 (2014 年 2 月).
- [23] 東京理科大学 (第 5 回時系列分析と金融工学のセミナー) (2013 年 6 月).
- [22] 一橋大学、経済研究所 (2013 年 2 月).
- [21] 慶應義塾大学、経済学部 (2012 年 12 月).
- [20] 早稲田大学 (第 4 回時系列分析と金融工学のセミナー) (2012 年 6 月).
- [19] 一橋大学、経済研究所 (2012 年 3 月).
- [18] 広島経済大学、経済学部 (2012 年 3 月).
- [17] 広島経済大学、経済学部 (2011 年 12 月).
- [16] 慶應義塾大学、経済学部 (2011 年 4 月).
- [15] 一橋大学、経済研究所 (2011 年 2 月).
- [14] 学習院大学、経済学部 (2010 年 7 月).
- [13] 横浜国立大学、経済学部 (2010 年 6 月).
- [12] 早稲田大学、商学部 (2010 年 4 月).

- [11] ワシントン大学シアトル校、経済学部 (2009 年 6 月).
- [10] 帝塚山大学、経済学部 (2009 年 4 月).
- [9] 広島経済大学、経済学部 (2008 年 12 月).
- [8] 日本銀行、金融研究所 (2008 年 8 月).
- [7] 一橋大学、ICS (2007 年 11 月).
- [6] 日本銀行、金融研究所 (2007 年 10 月).
- [5] 京都大学、経済学部 (2007 年 7 月).
- [4] 横浜国立大学、経済学部 (2007 年 6 月).
- [3] 日本銀行、金融研究所 (2007 年 2 月).
- [2] ワシントン大学シアトル校、経済学部 (2006 年 1 月).
- [1] ワシントン大学シアトル校、経済学部 (2005 年 1 月).

## 討論者

- [3] 日本ファイナンス学会第 28 回大会 (2020 年 6 月)
- [2] 日本経済学会 2013 秋季大会 (2013 年 9 月)
- [1] 日本経済学会 2012 春季大会 (2012 年 6 月)

## 大会、会議、集会での委員、

- [3] 日本経済学会 2022 秋季大会運営委員 (2022 年 10 月)
- [2] 2022 Asia Meeting of the Econometric Society, East and South-East Asia, Tokyo Japan, Local Organizing Committee Member (2022 年 8 月)
- [1] 日本統計学会第 16 回春季集会、企画行事委員、実行委員 (2022 年 3 月)

## 査読経験

*Annals of the Institute of Statistical Mathematics(2), Applied Economics(2), Asia-Pacific Financial Markets(9), Computational Statistics and Data Analysis, Econometric Reviews(2), Econometrics and Statistics, Econometric Theory(2), Economic Modelling(2), Economics Bulletin(3), Japan and the World Economy(3), Japanese Economic Review(4), Keio Economic Studies (3), Quarterly Review of Economics and Finance, Statistical Methodology, Statistics & Probability Letters, Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics, Tourism Management(2), 現代ファイナンス, 日本統計学会誌(2).*

## 教歴 (科目名が英語のものは英語で講義したもの)

### 講師

慶應義塾大学経済学部

- 統計学: 2017 年度秋学期(1 コマ)、2016 年度通年(2 コマ)、2015 年度通年(2 コマ)、2014 年度通年(2 コマ)、2013 年度通年(2 コマ)
- 計量経済学概論: 2012 年度後期(1 コマ)
- Applied Econometrics: 2012 年度前期(1 コマ)
- 時系列分析: 2017 年度秋学期(1 コマ)、2016 年度秋学期(1 コマ)、2015 年度春学期集中(2 コマ)、2014 年度春学期集中(2 コマ)、2013 年度春学期集中(2 コマ)、2012 年度通年(2 コマ)、2011 年度通年(2 コマ).
- Statistics: 2016 年度秋学期(1 コマ)

早稲田大学政治経済学部

- 時系列解析 A, B: 2015 年度通年(1 コマ).

上智大学経済学部

- 計量ファイナンス: 2015 年度春学期(1 コマ)、

横浜国立大学経済学部

- 計量経済学: 2011 年度通年(2 コマ).
- データ解析演習: 2010 年度後期(1 コマ)、2009 年度後期(1 コマ).

早稲田大学大学院ファイナンス研究科

- ファイナンスのための数学基礎: 2010 年度後期(1 コマ)、2010 年度前期(2 コマ).
- 確率・統計の基礎: 2010 年度後期(1 コマ)、2010 年度前期(1 コマ).
- ファイナンスのための時系列分析: 2012 年度後期(1 コマ)、2011 年度後期(1 コマ)、2010 年度後期(1 コマ).

ワシントン大学シアトル校経済学部

- Introduction to Microeconomics: 2006 年冬学期、春学期、2005 年秋学期.

### ティーチングアシスタント

ワシントン大学シアトル校経済学部

- Introduction to Microeconomics: 2006 年秋学期、2005 年冬学期、春学期、2004 年秋学期.
- Introduction to Macroeconomics: 2007 年冬学期.

