

計量経済学の基礎

— 統計的手法の理論とプログラミング —

著者紹介

戸田裕之 (とだ ひろゆき)

1985年 東京大学農学部卒業

1991年 Yale 大学大学院経済学研究科修了
(同年 Ph.D. in Economics)

1991年 筑波大学社会工学系講師 (94年 助
教授)

1995年 大阪大学社会経済研究所助教授

1998年 東京都立大学経済学部助教授 (00
年 教授)

2005年 大阪大学社会経済研究所招聘教授

この間, *Econometrica*, *Econometric Theory*, *Journal of Econometrics*, *Review of Economics and Statistics* などの学術誌に計量経済学理論に関する論文を発表。理論計量経済学世界ランキング 1989–1999 の [standardized page count](#) で 62 位, [impact citation](#) で 72 位。

山田 宏 (やまだ ひろし)

1990年 広島大学経済学部卒業

1994年 筑波大学大学院経営・政策科学研究科修了

1994年 日本学術振興会特別研究員 (DC1)

1997年 筑波大学大学院社会工学研究科単位取得退学 [99年博士 (社会経済)]

1997年 小樽商科大学商学部助教授

2000年 広島大学経済学部助教授

2004年 同大学院社会科学研究所助教授 (07
年 教授)

この間, *Journal of Econometrics*, *Economics Letters*, *Applied Economics*, *Journal of International Financial Markets, Institutions and Money* などの学術誌に計量経済学理論や実証分析の論文を発表。

著者らによる論文・著書の例として以下がある。

Toda, Hiro Y. and [Taku Yamamoto](#), 1995, Statistical Inference in Vector Autoregressions with Possibly Integrated Processes, *Journal of Econometrics* 66, 225–50.

[Oya, Kousuke](#) and Hiro Y. Toda, 1998, Dicky-Fuller, Lagrange Multiplier and Combined Tests for A Unit Root in Autoregressive Time Series, *Journal of Time Series Analysis* 19, 325–347.

Toda, Hiro Y. and [Colin R. McKenzie](#), 1999, LM tests for unit roots in the presence of missing observations: small sample evidence, *Mathematics and Computers in Simulation* 48, 457–468.

[Hatanaka, Michio](#) and Hiroshi Yamada, 2003, Co-trending: A Statistical System Analysis of Economic Trends, Springer.

Yamada, Hiroshi and [Yuzo Honda](#), 2005, Do Stock Prices Contain Predictive Information on Business Turning Points? A Wavelet Analysis, *Applied Financial Economics Letters* 1, 19–23.