

略歴と研究業績

前川 功一 教授

昭和18年6月26日生

〔略歴〕

学歴

昭和42年3月 広島大学政経学部政経学科卒業
昭和44年3月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程理論経済学および統計学専攻修了
昭和61年5月 経済学博士（大阪大学）

職歴

昭和44年4月 広島大学政経学部助手
昭和47年4月 広島大学政経学部講師
昭和49年9月～昭和50年8月
京都大学経済研究所研修員
昭和51年4月 広島大学政経学部助教授
昭和52年4月～昭和51年3月
広島大学大学院経済学研究科担当
昭和52年5月 広島大学経済学部助教授
昭和53年8月～昭和55年3月
ロンドン大学ロンドンスクールオブエコノミックス在外研究
昭和60年4月 広島大学経済学部教授
昭和61年4月 広島大学大学院社会科学研究科担当
昭和63年9月～平成元年6月
ウエスタン・オンタリオ大学客員教授
平成5年5月～平成15年5月
広島大学評議員（併任）
平成8年4月～平成13年4月
広島大学経済学部長（併任）（この間隔年で広島大学大学院社会科学研究科長）
平成13年5月～平成15年5月
広島大学副学長（併任）
平成13年5月～平成15年5月
広島大学評議員（併任）
平成13年5月～平成15年5月
広島大学アドミッションセンター長
平成13年5月～平成15年5月
広島大学西条共同研修センター長
平成14年4月～平成15年5月
広島大学教養教育企画室長
平成15年4月 広島大学金融工学プロジェクト研究センター長
平成16年4月 国立大学法人広島大学理事・副学長（財務担当）

所属学会

日本統計学会会員（評議委員 昭和63年－平成4年、平成6年－平成10年）

日本経済学会会員（理事 平成11年－平成14年）

Econometric Society 会員

日本金融・証券計量・工学学会会員（理事 平成8年－平成10年）

社会における活動

中小企業大学校（広島校）運営委員会議長

ひろぎん経済研究所理事

広島地域社会研究センター理事

統計数理研究所外部評価委員

日本学術振興会科学研究費委員

学位授与・評価機構経済系教育評価専門委員

公認会計士試験委員

公認会計士試験問題作成委員

日本統計学会誌編集委員

Econometric Theory誌編集委員

日本経済学会誌「Japan Economic Review」編集委員（co-editor）

〔研究業績〕

I 著書

『経済統計講義』（共著）、青林書院新社、昭和46年4月

『計量経済学』（共著）、青林書院新社、昭和52年6月

『回帰分析の漸近理論』、広島大学経済研究双書4、昭和60年3月

『Economic and Managerial Performance in Japan and Britain』（編著）、広島大学経済研究双書11、平成9年3月

『エクセルによる統計処理入門』（共著）、エコノミスト社、平成11年6月

II 訳書

C.E.V.Leser、『初等計量経済学』（共訳）、東洋経済新報社、昭和52年3月

Tomas Bjork、『数理ファイナンスの基礎—連続時間モデル—』、朝倉書店、平成18年1月

III 論文

| | | |
|---|----------|---------------------|
| 所得階層別消費者物価指数におけるアレン＝パウレイ方式の検討と拡充 | 昭和44年2月 | 『一橋研究』第16号 |
| 所得階層別消費者物価指数の階層間格差について | 昭和45年2月 | 広島大学『政経論叢』第19巻第3・4号 |
| 対数正規分布の推定（共著） | 昭和46年7月 | 広島大学『政経論叢』第21巻第1号 |
| パレート分布の推定 | 昭和46年10月 | 広島大学『政経論叢』第21巻第2号 |
| 個人所得分布の推定—対数正規分布とパレート分布の仮定のもとで— | 昭和47年8月 | 広島大学『政経論叢』第22巻第2号 |
| A Note on the Estimation of the Pareto Distribution | 昭和48年12月 | 『季刊理論経済学』第23巻第3号 |

| | | |
|---|------------|--|
| 二つのデータ期間における誘導形係数行列の同等性の検定 | 昭和49年 8 月 | 広島大学『政経論叢』第24卷第2号 |
| 同時方程式体系における構造変化の検定 | 昭和50年 7 月 | 広島大学『政経論叢』第25卷第2号 |
| An asymptotic expansion of the distribution of the test statistics for linear restrictions in Zellner's SUR model | 昭和55年10月 | 広島大学『経済論叢』第4卷第2号 |
| Relations among several asymptotic expansions in seemingly unrelated regression model | 昭和55年10月 | 広島大学『経済論叢』第5卷第4号 |
| Asymptotic distribution of the Chow test statistics for the simultaneous equation system when the disturbances are small | 昭和57年 5 月 | 広島大学『経済論叢』第6卷第1号 |
| A method for approximations to the PDF's and the CDF's of GLSE's and its application to the SUR model (共著) | 昭和57年10月 | Annals of institute of statistical Mathematics, Vol.34 |
| An Approximation to the Least Squares Estimation in AR(1) Model with the Exogenous Variables | 昭和58年 1 月 | Econometrica Vol.51 |
| Effects of non-orthogonal regressors on the distribution of seemingly unrelated regression estimator | 昭和58年 4 月 | 『日本統計学会誌』第13巻第2号 |
| Edgeworth expansions of the least squares estimator in ARMA(1,1) model with exogenous variables | 昭和58年 7 月 | 広島大学『経済論叢』第7巻第1号 |
| SURモデルにおける 2 段階推定量と最尤推定量の 3 次漸近有効性 | 昭和58年 7 月 | 広島大学『経済論叢』第7巻第1号 |
| The sampling distribution of the predictor for an auto-regressive model under misspecifications | 昭和59年 6 月 | Journal of Econometrics, Vol.25 |
| 一般線型回帰モデルにおける2段階推定量と最尤推定量 | 昭和59年 3 月 | 『広島大学年報経済学』第5巻 |
| Edgeworth expansion for the OLS estimator in a time series regression model | 昭和60年 | Econometric Theory Vol .1, No.2 |
| Finite sample properties of several predictors from an autoregressive model | 昭和62年 | Econometric Theory Vol.3, No.3 |
| Comparing the wald, LR and LM tests for heteroscedasticity in a linear regression model | 昭和63年 | Economics Letter Vol.26 |
| 非線型最小 2 乗法の 2 次漸近特性 (共著) | 昭和63年 6 月 | 広島大学『経済論叢』第12巻第1号 |
| Asymptotic expansions of the distributions of statistics related to the spectral density matrix in multivariate time series and their applications (共著) | 平成 2 年 | Econometric Theory Vol.6 |
| Asymptotic expansions and curvature measures in a nonlinear regression model | 平成 2 年 | Journal of Japan Statistic Society. Vol.20, No.2 |
| Approximate Null Distributions of the Durbin-Watson Test Statistic for Nonlinear Regression Model (共著) | 平成 3 年 9 月 | Hiroshima Economic Review, Vol.15 No.2 |
| Prewhitened unit root test | 平成 6 年 | Economics Letter Vol.45 |
| The Distribution of the Durbin-Watson Statistic in Integrated and Near Integrated Models (共著) | 平成 6 年 | Journal of Econometrics, Vol.61 |
| The exact distribution of the OLS and GLS estimators in regression with an integrated regressor and correlated errors-comparison of numerical and Monte Carlo integration- (共著) | 平成 7 年 | Mathematics and computers in simulation, Vol.39 |

| | | |
|--|------------|---|
| Efficiency properties of feasible generalized least squares estimators in SURE models under non-normal disturbances (共著) | 平成 7 年 | Journal of Econometrics, Vol.66 |
| Estimation in dynamic regression with an integrated process (共著) | 平成 8 年 | Journal of statistical planning and inference, Vol.49 |
| Approximate distribution of Durbin-Watson Test Statistic in Non-Linear Regression Models (共著) | 平成 9 年 | Rivista de la Sociedad Argentina de Estadística Vol.1 No.1 |
| Effects of Stock Price Volatility on Consumption : a comparison between Japan and the UK (共著) | 平成 9 年 3 月 | Hiroshima University Economic Monograph Series 11 |
| Periodically integrated autoregression with a structural break | 平成 9 年 | Mathematics and computers in simulation, Vol.43 |
| Finite Sample Comparisons of the Distributions of the OLS and GLS Estimators in Regression with an Integrated Regressor and Correlated Errors | 平成10年 | Econometric Review Vol.17 No.4 |
| The use of the Durbin-Watson test in non-linear regression models (共著) | 平成11年 | Pakistan Journal of Statistics, Vol.15(1) |
| On spurious Granger causality (共著) | 平成13年 | Economics Letters Vol.73 |
| F test for unit roots in a VAR Model (共著) | 平成13年12月 | 香川大学『経済論叢』第74巻第3号 |
| SUR model with integrated regressors (共著) | 平成14年 | Handbook of applied econometrics and statistical inference |
| Asymptotic properties of the estimator of the long-run coefficient in a dynamic model with integrated regressors and serially correlated errors (共著) | 平成15年12月 | The Japanese Economic Review, Vol.54, No.4 |
| The cusum test for parameter change in regression models with ARCH errors (共著) | 平成16年 | Journal of Japan Statistical Society, Vol.34, No.2 |
| Jump diffusion models for Japanese stock market | 平成17年 1 月 | Proceedings of the 2005 International Conference on Simulation and Modeling |
| 人民元切り上げの為替ボラティリティ効果(共著) | 平成17年12月 | 北研学刊 第二号 |
| Cusum test for parameter change in GARCH(1,1) models with application to Tokyo stock data (共著) | 平成18年 | Far East Journal of Theoretical Statistics Vol.18, No.1 |
| Test for parameter change in ARIMA models (共著) | 平成18年 | Communications in Statistics(Simulation and Computation), Vol.35, No.2 |