

履歴書

茂木快治 (Kaiji Motegi)

神戸大学大学院経済学研究科教授

【連絡先】

〒657-8501

兵庫県神戸市灘区六甲台町 2-1

神戸大学大学院経済学研究科

Eメール motegi@econ.kobe-u.ac.jp

個人ウェブサイト <http://www2.kobe-u.ac.jp/~motegi>

【職歴】

2014年6月－2015年3月	早稲田大学政治経済学術院	助手
2015年4月－2016年9月	早稲田大学政治経済学術院	助教
2016年10月－2020年3月	神戸大学大学院経済学研究科	講師
2020年4月－2026年3月	神戸大学大学院経済学研究科	准教授
2026年4月－現在	神戸大学大学院経済学研究科	教授

【学歴】

2008年3月 早稲田大学政治経済学部経済学科卒業(1079名総代), 「学士(経済学)」取得
2008年4月 早稲田大学大学院経済学研究科修士1年コース進学
2009年3月 同課程修了(16名総代), 「修士(経済学)」取得
2009年4月 早稲田大学大学院経済学研究科博士後期課程進学
2009年8月 ノースカロライナ大学チャペルヒル校経済学部博士課程入学
2014年5月 同課程修了, Doctor of Philosophy in Economics 取得
博士論文題目: Granger causality in mixed frequency time series
博士論文審査委員: Eric Ghysels (Chair), Michael Aguilar, Saraswata Chaudhuri,
Neville Francis, Jonathan B. Hill

【専門分野】

計量経済学, 時系列分析.

【書籍】

[1] 山下元監修, 瀧澤武信編著, 稲井田次郎, 上江洲弘明, 奥田良治, 金川秀也, 清水誠一, 鍾恂恂, 新海公昭, 富田真聡, 津田栄, 永島謙一, 橋口泰武, 茂木快治, 森岡正臣著 (2010), 『ファジィ理論—基礎と応用』, 共立出版株式会社. 2011年度日本知能情報ファジィ学会「著述賞」受賞.

【査読付き英文学術雑誌掲載論文】

- [1] E. Ghysels, J. B. Hill, and K. Motegi. Testing for Granger causality with mixed frequency data. *Journal of Econometrics*, vol. 192, May 2016, pp. 207-230.
- [2] K. Motegi and A. Sadahiro. Sluggish private investment in Japan's Lost Decade: Mixed frequency vector autoregression approach. *North American Journal of Economics and Finance*, vol. 43, January 2018, pp. 118-128.
- [3] J. B. Hill and K. Motegi. Testing the white noise hypothesis of stock returns. *Economic Modelling*, vol. 76, January 2019, pp. 231-242.
- [4] S. Hamori, K. Motegi, and Z. Zhang. Calibration estimation of semiparametric copula models with data missing at random. *Journal of Multivariate Analysis*, vol. 173, September 2019, pp. 85-109.
- [5] E. Ghysels, J. B. Hill, and K. Motegi. Testing a large set of zero restrictions in regression models, with an application to mixed frequency Granger causality. *Journal of Econometrics*, vol. 218, October 2020, pp. 633-654.
- [6] J. B. Hill and K. Motegi. A max-correlation white noise test for weakly dependent time series. *Econometric Theory*, vol. 36, October 2020, pp. 907-960.
- [7] K. Motegi, X. Cai, S. Hamori, and H. Xu. Moving average threshold heterogeneous autoregressive (MAT-HAR) models. *Journal of Forecasting*, vol. 39, November 2020, pp. 1035-1042.
- [8] S. Hamori, K. Motegi, and Z. Zhang. Copula-based regression models with data missing at random. *Journal of Multivariate Analysis*, vol. 180, November 2020, #104654.
- [9] C. Ai, O. Linton, K. Motegi, and Z. Zhang. A unified framework for efficient estimation of general treatment models. *Quantitative Economics*, vol. 12, July 2021, pp. 779-816.
- [10] K. Motegi and Y. Iitsuka. Inter-regional dependence of J-REIT stock prices: A heteroscedasticity-robust time series approach. *North American Journal of Economics and Finance*, vol. 64, January 2023, #101840.
- [11] K. Motegi and S. Woo. A note on the exponentiation approximation of the birthday paradox. *Communications in Statistics - Theory and Methods*, vol. 53, 2024, pp. 6417-6426.
- [12] K. Motegi and S. Hamori. Conditional threshold effects of stock market volatility on crude oil market volatility. *Energy Economics*, vol. 143, March 2025, #108189.
- [13] K. Motegi and S. Sugano. Cross-regional spillover effects of sustainability indices: A heteroscedasticity-robust VAR approach. *International Review of Financial Analysis*, vol. 108, December 2025, #104678.
- [14] K. Motegi and S. Hayashi. A groupwise approach to the birthday paradox. *Communications in Statistics - Theory and Methods*, vol. 55, 2026, pp. 640-658.

【ワーキングペーパー】

- [1] J. W. Dennis and K. Motegi (2022). Asymptotic properties of spurious regression and random walks with generalized drifts. SSRN Working Paper #3381194.
- [2] K. Motegi, J. W. Dennis, and S. Hamori (2024). Conditional Threshold Autoregression (CoTAR). SSRN Working Paper #3960058.
- [3] K. Motegi, J. W. Dennis, and S. Y. Hong (2025). Regular and reverse Midastar models: Threshold autoregression with mixed frequency data. SSRN Working Paper #4286939.
- [4] K. Motegi and J. W. Dennis (2024). An over-rejection puzzle of bootstrap average tests for the no-threshold-effect hypothesis. SSRN Working Paper #4739462.

【書評】

- [1] 「経済学のカリスマ的指導者による入門書」, 公益財団法人サントリー文化財団・アステイオン編集委員会編, 『アステイオン 90』, 株式会社 CCC メディアハウス発行, pp. 224-228, 2019年5月。(田中久稔著, 『経済数学入門の入門』, 岩波新書に対する書評.)

【主な受賞歴】

- [1] 2014年度統計関連学会連合大会コンペティション・セッション「最優秀報告賞」, 統計関連学会連合, 東京大学, 2014年9月.
- [2] 2015年度統計関連学会連合大会コンペティション・セッション「優秀報告賞」, 統計関連学会連合, 岡山大学, 2015年9月.
- [3] 早稲田大学ティーチングアワード, ミクロ経済学入門, 2015年度春学期, 早稲田大学, 2016年3月.
- [4] 第10回日本統計学会春季集会ポスターセッション「優秀発表賞」, 一般社団法人日本統計学会, 東北大学, 2016年3月.
- [5] 第11回日本統計学会春季集会ポスターセッション「優秀発表賞」, 一般社団法人日本統計学会, 政策研究大学院大学, 2017年3月.
- [6] 第33回日本統計学会小川研究奨励賞, 一般社団法人日本統計学会, 2019年9月.
- [7] 令和元年度優秀若手研究者賞, 神戸大学, 2020年1月.
- [8] 第三回細谷賞, 東北大学大学院経済学研究科, 2021年11月.
- [9] 第13回(令和6年度)前之園記念優秀若手論文賞, 一般財団法人敬愛まちづくり財団, 神戸大学, 2024年7月.

【主な奨学金】

- [1] フルブライト奨学金(大学院留学プログラム), 日米教育委員会, Institute of International Education, 2009年—2014年.
- [2] <日本人派遣留学プログラム>奨学金, 公益財団法人吉田育英会, 2010年—2013年.

【主な研究助成金】

- [1] 若手研究者のためのチャレンジ研究助成, 公益財団法人サントリー文化財団, 2016年4月—2017年3月.
- [2] 科学研究費助成事業・若手研究(B), 課題番号 16K17104, 独立行政法人日本学術振興会, 2016年4月—2019年3月.
- [3] 研究助成金, 公益財団法人三菱 UFJ 信託奨学財団, 2017年4月—2018年3月.
- [4] 学術奨励金, 公益財団法人二十一世紀文化学術財団, 2017年4月—2019年3月.
- [5] 社会科学研究助成, 公益財団法人野村財団, 2017年4月—2019年3月.
- [6] 日本経済研究センター研究奨励金, 公益社団法人日本経済研究センター, 2018年4月—2020年3月.
- [7] 財政・金融・金融法制研究基金研究助成金, 公益財団法人日本法制学会, 2018年4月—2019年3月.
- [8] 科学研究費助成事業・若手研究, 課題番号 19K13670, 独立行政法人日本学術振興会, 2019年4月—2022年3月.
- [9] 2020年度学術研究助成事業, 公益財団法人全国銀行学術研究振興財団, 2020年4月—2022年3月.
- [10] 令和2年度研究助成金, 公益財団法人石井記念証券研究振興財団, 2020年8月—2022年3月.
- [11] 社会科学研究助成, 公益財団法人野村財団, 2022年10月—2024年9月.
- [12] 研究調査助成金, 公益財団法人日本証券奨学財団, 2022年10月—2023年9月.
- [13] 研究助成, 公益財団法人村田学術振興財団, 2023年8月—2024年7月.
- [14] 科学研究費助成事業・挑戦的研究(萌芽), 課題番号 23K17555, 独立行政法人日本学術振興会, 2023年6月—2026年3月.
- [15] 研究助成, 公益財団法人トラス未来フォーラム, 2025年4月—2027年3月.
- [16] 財政・金融・金融法制研究基金研究助成金, 公益財団法人日本法制学会, 2025年4月—2026年3月.
- [17] 科学研究費助成事業・基盤研究(B), 課題番号 26K00326, 独立行政法人日本学術振興会, 2026年4月—2030年3月.

【主なカンファレンス・セミナーでの研究報告】

- [1] North American Summer Meeting of the Econometric Society, University of Southern California, CA, June 2013.
- [2] NBER-NSF Time Series Conference, Federal Reserve Board, Washington DC, September 2013.
- [3] 2014年度統計関連学会連合大会, 東京大学, 2014年9月.
— コンペティション・セッション「最優秀報告賞」受賞.
- [4] NBER-NSF Time Series Conference, Federal Reserve Bank of St. Louis, MO, September 2014.

- [5] 25th (EC)² Conference, Universitat Pompeu Fabra, Barcelona, Spain, December 2014.
- [6] SETA Conference 2015, Hitotsubashi University, Tokyo, Japan, May 2015.
- [7] 11th World Congress of Econometric Society, Palais des Congres de Montreal, Montreal, Canada, August 2015.
- [8] 2015年度統計関連学会連合大会, 岡山大学, 2015年9月.
— コンペティション・セッション「優秀報告賞」受賞.
- [9] Recent Developments in Time Series and Related Fields, Tohoku University, Miyagi, Japan, December 2015.
- [10] 第10回日本統計学会春季集会, 東北大学, 2016年3月.
— ポスターセッション「優秀発表賞」受賞
- [11] AMES 2016, Doshisha University, Kyoto, Japan, August 2016.
- [12] NBER-NSF Time Series Conference, Columbia University, NY, September 2016.
- [13] UNC Econometrics Workshop, Department of Economics, University of North Carolina at Chapel Hill, NC, February 2017.
- [14] 第11回日本統計学会春季集会, 政策研究大学院大学, 2017年3月.
— ポスターセッション「優秀発表賞」受賞
- [15] 50th Anniversary Seminar, Department of Statistics and Actuarial Science, University of Hong Kong, Hong Kong, June 2017.
- [16] EcoSta Conference 2017, Hong Kong University of Science and Technology, Hong Kong, June 2017 (session organizer and speaker).
- [17] 4th Annual Conference of IAAE, Hotel Emisia Sapporo, Hokkaido, Japan, June 2017.
- [18] 3rd Annual International Conference on Applied Econometrics in Hawaii, Honolulu, Hawaii, September 2017.
- [19] Economics and Economic Growth Centre Seminar Series, School of Social Sciences, Nanyang Technological University, Singapore, January 2018.
- [20] EcoSta Conference 2018, City University of Hong Kong, Hong Kong, June 2018 (session organizer and speaker).
- [21] Departmental seminar, Department of Statistics and Actuarial Science, University of Hong Kong, Hong Kong, June 2018.
- [22] Departmental seminar, Institute of Statistics and Big Data, Renmin University of China, Beijing, China, August 2018.
- [23] UNC Econometrics Workshop, Department of Economics, University of North Carolina at Chapel Hill, NC, November 2018.
- [24] Presidential session, 88th Annual Meeting of Southern Economic Association, Washington DC, November 2018.
- [25] Essex Centre for Macro and Financial Econometrics Seminar Series, Department of Economics and Business School, University of Essex, Colchester, UK, January 2019.

- [26] 15th International Conference of WEAI, Keio University, Tokyo, Japan, March 2019.
- [27] SETA Conference 2019, Osaka University, Osaka, Japan, June 2019.
- [28] 「第33回日本統計学会小川研究奨励賞」受賞記念講演, 2019年度統計関連学会連合大会, 滋賀大学, 2019年9月.
- [29] Departmental seminar, Department of Economics, University of Essex, Colchester, UK, September 2019.
- [30] 「第三回細谷賞」受賞記念講演, 東北大学大学院経済学研究科, 2021年11月.
- [31] 6th Annual International Conference on Applied Econometrics in Hawaii, virtual session, November 2021 (organizer and speaker).
- [32] EcoSta Conference 2022, virtual session, June 2022 (session organizer and speaker).
- [33] SETA Conference 2022, virtual session, July 2022.
- [34] 2022 AMES in East and South-East Asia, virtual session, August 2022.
- [35] 7th Annual International Conference on Applied Economics in Hawaii, virtual session, November 2022 (organizer and speaker).
- [36] 17th International Conference of WEAI, virtual session, April 2023.
- [37] 98th Annual Conference of WEAI, virtual session, July 2023.
- [38] EcoSta Conference 2023, Waseda University, Tokyo, Japan, August 2023 (scientific program committee member, session organizer, and speaker).
- [39] **International Conference on Time Series Econometrics (ICTSE)**, Kobe University, Hyogo, Japan, March 2024 (organizer, chair, and speaker).
- [40] 99th Annual Conference of WEAI, virtual session, June 2024.
- [41] NTU Economics Seminar, School of Social Sciences, Nanyang Technological University, Singapore, July 2024.
- [42] Singapore Economic Review Conference, voco Orchard Singapore, Singapore, July 2024.
- [43] 9th Annual International Conference on Applied Economics in Hawaii, Honolulu, September 2024.
- [44] 第92回丸の内QFセミナー, 東京都立大学丸の内サテライトキャンパス, 2024年11月.
- [45] 100th Annual Conference of WEAI, virtual session, June 2025.
- [46] 日本銀行金融研究所セミナー, 2025年7月.
- [47] EcoSta Conference 2025, Waseda University, Tokyo, Japan, August 2025.
- [48] ワークショップ「近代経済学のフロンティアに関する研究」, 青山学院大学経済学部経済研究所, 2025年10月.
- [49] SETA Conference 2026, University of Tokyo, Tokyo, Japan, June 2026.
- [50] 101st Annual Conference of WEAI, virtual session, June 2026.
- [51] EcoSta Conference 2026, Ryukoku University, Kyoto, Japan, August 2026 (scientific program committee member, session organizer, and speaker).

【学術雑誌編集業務】

- [1] Associate Editor, *Singapore Economic Review*, January 2018—present.
- [2] Associate Editor, *Econometrics and Statistics* (Part A: Econometrics), January 2026—present.

【主な担当講義】

- [1] 早稲田大学 (2015年4月—2016年9月)
 - ・ Time Series Analysis (Master's level)
 - ・ Macroeconomics (Master's level)
 - ・ ミクロ経済学入門演習 (学部初年次)
 - ・ マクロ経済学入門演習 (学部初年次)
 - ・ 基礎演習 (学部初年次)
- [2] 神戸大学 (2016年10月—現在)
 - ・ Analysis of Stationary Time Series (Master's level)
 - ・ Analysis of Nonstationary Time Series (Master's level)
 - ・ 計量経済学 (学部・大学院)
 - ・ 研究指導 (学部・大学院)
 - ・ 初年次セミナー・基礎演習 (学部初年次)
 - ・ 統計学 (学部初年次必修科目)
- [3] 時系列分析に関する連続講義, 横浜市立大学, 2024年12月.

【その他の研究・教育活動】

- [1] 「5年間の米国大学院留学を終えて」, ブログ記事, 公益財団法人吉田育英会, 2014年10月,
https://www.yssf.or.jp/blog/article_detail.php?repoId=16
- [2] 「異分野 Cross Talk」パネリスト, 吉田育英会会報誌『環(WA)』創刊号, 公益財団法人吉田育英会, 2017年9月.
- [3] 「計量経済学におけるモンテカルロ実験の基本」, 『経済学・経営学学習のために』, 平成30年度前期号, pp. 19-28, 神戸大学経済経営学会, 2018年4月.
- [4] 「コンピュータモデル, 欠損データ分析, 因果推論の融合に関する考察」, 『国民経済雑誌』, 第218巻, 第5号, pp. 65-75, 神戸大学経済経営学会, 2018年11月.
- [5] 「混合頻度ベクトル自己回帰モデルとグレンジャー因果性検定」, 『日本統計学会誌』, 第50巻, 第1号, pp. 191-204, 日本統計学会小川研究奨励賞特別寄稿論文, 一般社団法人日本統計学会, 2020年9月.
- [6] 「時変閾値を伴う非斉時的自己回帰モデル」, 『国民経済雑誌』, 第222巻, 第3号, pp. 61-72, 神戸大学経済経営学会, 2020年9月.
- [7] 2021年度統計関連学会連合大会プログラム委員, オンライン開催, 統計関連学会連合, 2021年9月.

- [8] 科学研究費助成事業審査委員，審査第四部会(若手研究)，第 07030 小委員会(経済統計関連)，独立行政法人日本学術振興会，2021 年度~2022 年度.
- [9] 「コロナ感染状況の傾向はなぜ日米で異なるのか?」，経済学者が読み解く現代社会のリアル (第 147 回)，『週刊東洋経済』，2022 年 1 月 15 日号，pp. 78-79，東洋経済新報社.
- [10] 「時変閾値自己回帰モデルについて」，『国民経済雑誌』，第 225 卷，第 4 号，pp. 83-93，神戸大学経済経営学会，2022 年 4 月.
- [11] 2022 年度統計関連学会連合大会プログラム委員，成蹊大学，統計関連学会連合，2022 年 9 月.
- [12] Scientific Program Committee Member, EcoSta Conference 2023, Waseda University, Tokyo, Japan, August 2023.
- [13] 「Midastar モデルについて—閾値自己回帰モデルと混合頻度データ」，『国民経済雑誌』，第 228 卷，第 3 号，神戸大学経済経営学会，2024 年 9 月.
- [14] 日本経済学会 2025 年度春季大会，ネットワーキング・セッション，メンター，中京大学名古屋キャンパス，2025 年 5 月 24 日.
- [15] Scientific Program Committee Member, EcoSta Conference 2026, Ryukoku University, Kyoto, Japan, August 2026.

以上