

七宮 圭 (ななみや けい)

2012 年度 COE 研究員

連絡先 : b091287@r.hit-u.ac.jp

(メールを送る際は、“at”の箇所を@に変更してください)

専攻分野 : 時系列分析、計量ファイナンス

研究テーマ : ウェーブレット解析を利用した高頻度ファイナンスデータの時系列分析

博士学位請求論文題目 : Wavelet analysis for long memory processes

学歴

2003 年 3 月 横浜国立大学経済学部経済システム学科卒業

2006 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科修士課程 (経済理論・経済統計専攻) 修了、経済学修士

2012 年 3 月 一橋大学大学院経済学研究科博士後期課程 (経済理論・経済統計専攻) 修了、経済学博士

職歴

2006 年 5 月～2007 年 3 月 ティーチングアシスタント

2006 年 7 月～2007 年 3 月 リサーチ・アシスタント

2008 年 10 月～2009 年 3 月 COE リサーチ・アシスタント

2009 年 6 月～2010 年 3 月 COE リサーチ・アシスタント

2010 年 6 月～2011 年 3 月 COE リサーチ・アシスタント

2011 年 6 月～2012 年 3 月 COE リサーチ・アシスタント

2012 年 4 月～ COE 研究員

2012 年 4 月～ 神奈川大学経済学部非常勤講師

研究業績

・論文

Nanamiya, K., (2011), “The wavelet-based estimation for long memory signal plus noise models,” Global COE Hi-Stat DP No.210

Nanamiya, K., (2012), “Wavelet analysis for long memory processes”, Ph.D. Thesis Submitted to Hitotsubashi University.

・学会報告

Nanamiya, K., (2010), “A Note on Wavelet-Based Multi-Scale Regression Model with Trend,” 2010 年度統計関連学会連合大会 (早稲田大学) 2010 年 9 月 7 日、事前審査無

Nanamiya, K., (2011), “Wavelet-based estimation problem for long-memory signal plus noise models,”
2011 年度統計関連学会連合大会（九州大学）2011 年 9 月 6 日、事前審査無

紹介先

田中勝人（一橋大学大学院経済学研究科教授） 渡部敏明（一橋大学経済研究所教授）