

## 1 英語のテキスト

- Hansen, B. E. (2022) *Econometrics*, Princeton University Press.
  - 計量経済学の超定番の教科書なので、詳細は省略。
- Li, Q. and J. S. Racine. (2007) *Nonparametric Econometrics: Theory and Practice*, Princeton University Press.
  - 京大経研 (2024 年)「計量経済学 1, 2」(西山慶彦先生ご担当)で輪読している教科書。
  - ノンパラの教科書の定番らしい。
  - 過去には, Hansen 先生 (2009 年, University of Wisconsin) や末石先生 (2014 年, 京大) のトピックコースでも使用していたらしい。
  - ECON 718 NonParametric Econometrics Spring 2009 Bruce Hansen
  - <https://users.ssc.wisc.edu/~bhansen/718/718.htm>
  - セミ・ノンパラメトリック計量分析
  - <https://sites.google.com/site/naoyasueishij/teaching/nonpara?authuser=0>
- van der Vaart, A. W. (2000) *Asymptotic Statistics*, Cambridge University Press.
  - 数理統計学の超定番の教科書なので、詳細は省略。
  - Chapters 24, 25 がノンパラ, セミパラを扱っている。
- ほかにいろいろあると思うけれど、読んだことあるのはこれだけ。

## 2 日本語のテキスト

- 久保木久孝, 鈴木武 (2015) 『セミパラメトリック推測と経験過程』朝倉書店。
  - 最近買ったところだから何とも言えない。これから読む。
  - セミパラというより Empirical Process の勉強に使う本っぽい (それが目的で買った)。
- 末石直也 (2015) 『計量経済学：ミクロデータ分析へのいざない』日本評論社。
  - ノンパラを扱ってるのは 9 章。
  - パラメトリックの枠は出ないけど、分位点回帰, 打ち切りモデル, Binary Choice モデルなどなど, ノンパラ・セミパラで推定したいモデルの基礎がひとつと説明されている。
- 末石直也 (2024) 『データ駆動型回帰分析：計量経済学と機械学習の融合』日本評論社。
  - ノンパラ：3 章, セミパラ：4 章。
  - お気持ち部分を丁寧に概観できる。
- 西山慶彦, 人見光太郎 (2023) 『ノン・セミパラメトリック統計解析 (理論統計学教程：数理統計の枠組み)』共立出版。
  - だいたい全部ここに載っている。
  - ややこしすぎる証明は元ペーパーを参照する形でカットされていて、読み進めやすい気がする。
  - Li and Racine (2007) の輪読会の準備をするときは、これで予習してます。

## 3 Paper

いっぱいあるから省略。