

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.

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).
- 清水泰隆 (2021) 『統計学への確率論, その先へ: ゼロからの測度論的理解と漸近理論への架け橋』内田老鶴圃.
 - 測度論をひとつとおり勉強できる. 優収束定理等の積分と極限の扱いを勉強するのに役立った.
- 清水泰隆 (2023) 『統計学への漸近論, その先は: 現代の統計リテラシーから確率過程の統計学へ』内田老鶴圃.
 - コアノメの副読本みたいな感じで読んで. ノンパラは 5 章.
- 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おり説明されている.
- 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.