

NonParametrics 2024

Yasuyuki Matsumura*

2024 年 11 月 5 日

1 参考文献：英語のテキスト

- Hansen, B. E. (2022) *Econometrics*, Princeton University Press.
 - 計量経済学の超ド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.
 - 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.
 - 数理統計学の超ド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.

*M1 Student at Graduate School of Economics, Kyoto University. yasu0704xx@gmail.com.

2 参考文献：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.
 - 測度論をひとつお勉強できる. 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お説明されている.
- 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 参考文献：Paper

いっぱいあるから省略.