

# Nonparametric Econometrics 2024

Yasuyuki Matsumura\*

2024 年 12 月 15 日

## 1 教科書

- Li, Q. and J. S. Racine. (2007) *Nonparametric Econometrics: Theory and Practice*, Princeton University Press.
  - 2024 年度の計量経済学 1, 2 (by 西山慶彦先生) で輪読しています。シラバスはこちらからどうぞ: [https://www.k.kyoto-u.ac.jp/student/g/ec/support/syllabus\\_detail?no=5934](https://www.k.kyoto-u.ac.jp/student/g/ec/support/syllabus_detail?no=5934)
  - タイポが多くて、読み進めるのがやや面倒くさい。
  - Errata にない間違いも多数。
  - 過去には、下記のトピックコースでも使用されていたらしい。
  - Bruce Hansen, ECON 718 NonParametric Econometrics (University of Wisconsin, Spring 2009). <https://users.ssc.wisc.edu/~bhansen/718/718.htm>
  - 末石直也, セミ・ノンパラメトリック計量分析 (京都大学, 2014 年度後期) . <https://sites.google.com/site/naoyasueishij/teaching/nonpara?authuser=0>
  - 各先生方のレクチャーノートは一般公開されている (2024 年 12 月現在) .

## 2 参考文献：英語のテキスト

- Hansen, B. E. (2022) *Econometrics*, Princeton University Press.
  - 19, 20, 21 章でノンパラメトリック推定や regression Discontinuity の話を扱っている。

---

\*M1 Student at Graduate School of Economics, Kyoto University. yasuo704xx@gmail.com.

- Horowitz, J. L. (2009) *Semiparametric and Nonparametric Methods in Econometrics*, Springer.
  - セミパラメトリック推定の話が一通りまとまっている.
- 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.

### 3 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.
  - セミパラというより Empirical Process の本っぽい. Glivenko-Cantelli とかでてくる.
- 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.
  - ノンパラは9章で軽めに扱っている.
  - 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.
- 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.

- 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。

#### 4 参考文献：論文たち

- きりがないので省略. 上記テキストの参考文献リスト等を見てください.