

## 計量経済学でのデータ分析とグラフ作成ソフト EViews



## ユーザ訪問インタビュー

専修大学 商学部

研究分野：計量経済学、理論経済学

教授 大林 守 先生

EViews の用途：研究（経済モデル・予測）、教育

- ・「経済モデルによる年金改革の分析－数量経済分析の鑑賞方法、府川・加藤編、年金改革の経済分析－数量モデルによる評価 第4章」日本評論社（2006）
- ・「計量モデル屋、証人台に立つ」法と経済学研究 3/1（2006）<http://www.jlea.jp/ronbun3-1.pdf>  
（大林研究室のホームページ：<http://www.obayashi.net/>）



「とにかく計量の仕事に関してはなんでもやる。ゴルフ場の予測をやっている横で某政党の政策書きをする。シンクタンクというのはそういうところなんですよ。」シンクタンクでの研究歴が長かった大林先生は、世界経済モデルからインドネシアやブラジルの計量モデル、社会保障政策や知的財産に関係する研究まで、「仕事が私を追いかけてくる」というほどさまざまな経済分析を経験されてきました。この分野のソフトウェアに関する知識と経験も半端ではなく、世界中の数多くのソフトウェアを試されたそうです。このように、計量の分野で精力的に活動している大林先生に、専修大学生田キャンパスでお話をうかがいました。

## 大型計算機の時代から比べれば EViews は天国！

## ● スタートは大型計算機で計量分析！

「計量経済の世界の生きた化石ですよ。」

ご自分のことをこう表現する大林先生。計量経済学には学生時代の頃から今に至るまでずっと携わっているそうです。

「幸い私が学生の頃にはコンピュータがあったので、5000 行ぐらいある回帰分析のプログラムをカードに打ち込んで、IBM の大型計算機で計算させるというようなことしていました。でも、私の指導教官の福地崇生先生の時代には、大きな部屋の真ん中に模造紙を置いて、タイガーとかモンローといった手回し式計算機を、がらがらまわしながら計算していたんですよ。EViews が何秒かでする計算を1カ月もかけて計算していたわけですから、EViews は天国みたいですよ。」

計算すること自体が大変だった時代から計量経済の研究を行ってきた大林先生。計量分析を行う上で、自作のプログラムで計算するのはもちろんのこと、計量に関係するソフトもたくさん試されたそうです。EViews についても、MicroTSP が EViews に進化した時代から使っていたということですから、この分野のソフトに関する大林先生の知識と経験は半端ではありません。

もちろん、現在も「全部使っている」というほどさまざまなソフトを利用して、用途によりそれぞれを使い分けているそうです。その中には、もちろん EViews も含まれています。

「EViews は特にグラフィックスがきちんとしていて、そのあたりが楽にできるのがいいですね。あとは値段と手軽さがいいですね。」

分析結果を視覚化するときの手軽さが特に気

に入れているそうです。また、予測を行う場合、分析に利用したさまざまなモデルやシナリオを残しておかないと、あとで困るのだそうですが、EViews を使うとその点でも便利だといいます。

「データ容量的には相当無駄にしているのかもしれませんが、予測や政策シミュレーションをやる人間には EViews 以外ありえないですよ。」

## ● 大学院生の授業は EViews の利用を前提に

大林先生が教鞭をとられている専修大学では、EViews のアカデミックサイトライセンスを導入しています。キャンパス単位で複数ライセンスを導入することで、シングルライセンスを必要な本数分ご購入いただくより価格が大きく割引されるライセンス形態です。これにより、専修大学ではコンピュータールームなどで学生も EViews を利用できる体制になっています。学生や院生の教育という点では、専修大学では、EViews はどのように利用されているのでしょうか。

「学部の学生には、まず文系の人間が嫌がる数学や統計学をやらせて…というところから始めるので、EViews でなくてもいいのが現実です。」

学びたての学生にはいきなり EViews のような専門ソフトを使わせるのではなく、まず基礎からスタート。実際に EViews を利用するのはゼミもしくは大学院生からだそうです。

「我々は大型計算機の時代からやっているから（EViews のようなソフトは）なんて便利なんだろうと感激があるけれど、彼らにとっては最初からあるものなので、我々の持つ感激がないわけで

（裏面に続く）



LightStone

株式会社ライトストーン

〒130-0026

東京都墨田区両国4-30-8 両国Y・Aビル6階

TEL 03-5600-7201 FAX 03-5600-6671

e-Mail [sales@lightstone.co.jp](mailto:sales@lightstone.co.jp) <http://www.lightstone.co.jp/>

## 計量経済学でのデータ分析とグラフ作成ソフト EViews

すよ。ボタンをぼんと押せばできるのが当たり前と。それで最初はExcelで苦労させるんです。本当はこれぐらいやらないといけないんだよ。」

EViewsを使わないからといって専門的な教育ができないわけではなく、Excelでもさまざまなことができ、不便なところが教育的にはよいこともあるとか。

「(Excelの) マクロでもいくつかソフトがあるんですよ。マクロをいくつか組み合わせると計量でも十分使える。マクロだけで計量モデルが解けるようなものも出ているんですよ。」

学部の段階では使わなくても、大学院の授業ではEViewsを利用することが前提だそうです。

「大学院では、最初からEViewsを使わせています。教科書に書いてある推計問題とかデータとかを全部EViewsに入力させて、同じ結果が出るかどうかを確かめさせます。」

最初は日本語のテキストを使うものの、すぐに英語のテキストに変えてしまうそうです。

「英語のテキストの場合、練習問題や例がいっぱいあるんですよ。データもEViews用になっていて、出版社のWebサイトからダウンロードできます。そういった面でもEViewsはいいですね。」

EViewsが世界中で幅広く使われていて、EViews形式のデータが入手しやすいということも、大きなメリットとなっているようです。

**● 危険性を認識して使うことが重要！**

このように、大林先生には、EViewsの便利さや使い勝手の良さを大変評価していただいています。誰でも手軽に分析ができてしまうことに対して、先生は警鐘も鳴らしています。損害賠償訴訟裁判の計量モデルに関する専門家証人の経験もあるそうです。

「ただ、簡単にできすぎてしまうから危ないですよ。そのため荒っぽい分析も結構見かけます。ある程度の経験とか理論的バックグラウンドを持つ指導者がいないところで使う危険性は感じています。そういった意味では、ライトストーンさんには売るだけではなくてそういうコンサルティングとか危険性を指摘するようなサービスをぜひやってもらいたいというのが希望です。」

**● EViews用のプログラムをWebで公開！**

大林先生は以前からプログラムや計量モデルを公開していますが、EViewsのプログラムもWeb上で公開しています。そのひとつが「Threshold Regression マニュアル」です。

経済成長と中小企業の関係を分析する際に、経済の発展段階別に中小企業の役割が異なるのではないかという仮説を検証するために、同僚の山田節夫先生と作成したのだそうです。

「最初はダミーを入れたりいろいろなことを試したのですが、Threshold Regression手法を見つけ、それを実現するためにEViewsプログラムにしました。データベースと分析のプラットフォームがEViewsなのでほかのソフトを使うのが面倒ですし、応用可能性も期待したからです。」

応用としては、知財保護と経済成長の関係に関しておもしろい結果が出ています。

「Threshold Regressionマニュアル」は、専修大学オープンリサーチセンターのWebで公開中です (<http://www.senshu-u.ac.jp/~off1022/>)。

**—訪問を終えて—**

大林先生はとてもパワフルで話が幅広く、どのお話も、とても興味深いものでした。また、視覚化ということに大変興味があり、グラフに関する書籍もため込んでいる「隠れグラフ研究家」なのだそうです。そのグラフのお話も大変おもしろく、あっという間の1時間でした。

**ライトストーン ユーザ事例**

<http://www.lightstone.co.jp/user/>

