

## ユーザ訪問インタビュー

明治学院大学経済学部 教授 高橋 青天先生

専門分野：成長理論・動学ゲーム理論、公共経済学

近年発表の学術論文：

"Optimal Balanced Growth in a General Multi-sector Endogenous Growth Model with Constant Returns," *Economic Theory* Vol.37,#1、2008年(単著)"Endogenous Fluctuations in Two-sector models: Role of Preferences," forthcoming in *Journal of Optimization Theory and Application*, 2006(共著)

"収獲一定技術を持つ多部門経済の成長と循環の大域分析" 西村和雄・福田慎一編『非線形均衡動学-不決定性と複雑性-』(東大出版会) 第10章(2004年)(単著)



今回は明治学院大学白金キャンパスに経済学部・高橋青天教授をお訪ねしました。秋の気配も感じられる雨上がりの9月。大学の創設者であるヘボン博士のお話から、今回出版された『EViewsによる実証分析入門』まで、幅広くお話を伺いました。

### 初心者でも高度な実証分析ができることを目指して EViews の書籍を出版！

#### ● MicroTSP の時代から 20 年近く利用

—— 講習会のお打合せなどで研究室には度々お邪魔していますが、このようにゆっくり学内を歩くのは今回が初めてです。

【高橋先生】

明治学院大学の創設者は「ヘボン式」という言葉でも有名な、ヘボン博士です。幕末、日米修好通商条約の締結後、ヘボン博士は伝道のために日本を訪れて医療活動を行います。医療活動と並行して博士はヘボン塾を創立し、教育活動を行いながら本格的な和英/英和辞書の出版し、その流れが明治学院大学の設立への繋がって行くこととなります。

—— さっそくですが、先生が EViews を使うことになった「きっかけ」を教えてください。

【高橋先生】

学部ゼミでは初め Microfit という計量ソフトを使っていましたが、1990 年頃から EViews の前身である MicroTSP を使い始めました。私自身、自分の研究では主に TSP を利用していましたので、*American Economic Journal* か何かの雑誌で MicroTSP の存在を知り、すぐ注文したことを覚えています。

—— MicroTSP の時代も含めると、かれこれ 20 年近く EViews をご利用いただいている事になりますが、今回、『EViews で学ぶ実証分析入門』という本を明治大学の北岡先生、広島大学の矢野先生と共同執筆なさいました。この本の特徴を教えてください。

【高橋先生】

「基礎編」と「応用編」の 2 冊で出版されます。「基礎編」

では、EViews のシミュレーション機能を最大限利用し、理論的導出ではなく、読者自らが実験を行って標本分布を描き、それを眼で見て確かめることにより、計量分析を理解することに重点を置いています。

例えば、最小二乗推定から計算される係数の推定量の性質である、「不偏性」や「一致性」を、実際に「モンテカルロ実験」を行って確かめます。また、この実験を発展させた、近年注目を集めている「ブートストラップ法」も学びます。このように、自ら実験で確かめることで計量分析を理解するという点が、類書とは全く異なった特徴(基礎編第 4 章、第 5 章)です。

「応用編」では、各種統計量を「交通信号(シグナル)」として捉え、どのようなときに、「青信号」、「黄色信号」や「赤信号」であるのか。また「黄色信号」の場合、どのような点に注意をして分析を進めればよいのか、などを、実際の実証分析を通して解説しています。

例えば時系列分析の章では、『マクロ金融政策の時系列分析』(宮尾龍蔵著)で行われた実証分析方法が具体的に解説されています。また、私の担当したパネル分析の章(応用編第 5 章)では、最近注目を集めているダイナミックパネル分析が、具体的な分析例を使って解説されています。

#### ● 初心者でも EViews を使いこなせるように！

—— この本を書こうと思った動機を教えてください。

【高橋先生】

北岡先生も本書で言及されていますが、いま手に入れることができる計量ソフト(EViews, TSP, RATS, STATA, SHAZAM 等)の性能は、10 年前の計量ソフト、例えば EViews の前身である MicroTSP と比べても、「スバル



## 計量経済学でのデータ分析とグラフ作成ソフト EViews

360」と「フェラーリ」ぐらいの差があります。したがって、うまく使いこなすためには、かなりの熟練が必要です。

ところが、EViews はほかの計量ソフトとは違い、ダイアログ形式を採用しています。このことは、実証分析の初心者でも、うまく使いこなせばかなり高度な実証分析ができることを意味しています。フェラーリ級の EViews を、普通乗用車しか運転したことのない初心者でもうまく使いこなせるような解説書があれば、という思いからこの本の「基礎編」を書いた次第です。

また、フェラーリ級の車で、日本の富士スピードウェイを走らせる場合と、通常の道を走らせる場合では、その運転の仕方がまったく違います。このように、具体的な実証分析を行う場合にも細心の注意が必要です。具体的な実証分析例を使い、EViews でどのような点に注意をはらって分析を進めるのかを解説したのが「応用編」です。

—— 執筆に当たって苦労したところをお聞かせください。

【高橋先生】

これまでの EViews に関する解説書と違い、即、実践に結び付くように配慮しました。「基礎編」と「応用編」では、モンテカルロ実験やブートストラップ法使って統計量に関する標本分布を多数描いています。このための EViews プログラムを書くのに苦労しました。EViews のプログラミングは基本的には良くできているのですが、やはりプログラムのくせがあり、P. Kenedy や Dinardo などが書いた EViews プログラムを参考にしました。もっと簡潔なプログラムを書くことができると思いますので、これからも掲載のプログラムを改良したいと思います。

プログラムというと、30 年ほど前の学部生時代、所属していた計量経済学のゼミで FORTRAN という言語を使ってプログラムのループを書こうとして、大変苦労したことを思い出します。ところが EViews では、このようなループを簡潔に書くことができ、そのため、モンテカルロ実験やブートストラップのプログラムを非常にシンプルにできます。この点は EViews の非常にすぐれた特長です。みなさんもぜひプログラミングに挑戦して下さい。

—— 明治学院大学様では教育面でも EViews を積極的にご利用いただいておりますが、その利用方法をどのような

ものでしょうか。

【高橋先生】

EViews の特徴は、単なる最小二乗推定だけでなく、かなり高度な計量分析を、ダイアログ画面に答えていくだけで実行できることです。このことは、学生が行いたいと思っているどのような実証分析も、ほぼ実行可能であることを意味しています。私のゼミでは、VAR 分析やパネル分析などを使い、卒論テーマとして、「日銀の金融政策の評価」、「日本の国民貯蓄率の急速な低下要因」や「日本の地域格差問題」などを分析しています。

これらの成果の一部は、「応用編」の実証課題として、第 5 書の章末問題に掲載しています。ぜひ EViews を使って、このような高度な実証問題にチャレンジして下さい。

### ● 実践的に誤りのないよう使うことが大切！

—— 当社での EViews 講習会でも講師としてご協力いただいています。参加者のほとんどは、社会人実務者の方々ですが、実証分析に関する勉強の仕方や考え方についてアドバイスをお願いします。

【高橋先生】

私も含め、我々はあくまでも計量分析ソフトのユーザーであるという立場を確認することが大切だと思います。したがって、関連のある統計量の細かい理論的導出に注意を払うよりもより実践的に、EViews を使って得られた種々の統計量をシグナルとして理解し、誤りのないよう使うように心がけることが大切だと思います。

—— 最後に先生がご所属されている日本財政学会での最近の研究テーマについて教えてください。

【高橋先生】

最近は、「応用編」で解説したダイナミックパネル分析を県別データに適用し、地方政府の歳入・歳入決定に関する行動を動学的視点から分析するという共同研究を、江川雅司氏（明治学院大学）や宮本由紀氏（名城大学）と行っています。もちろん、EViews のダイナミックパネル分析機能を使って行うつもりです。

—— 今日は興味深いお話をうかがうことができました。ありがとうございました。



『EViews で学ぶ実証分析入門』 基礎編／応用編  
（日本評論社）北岡孝義・高橋青天・矢野順治 編著

### 即、実践に結び付く EViews 解説書

EViews を利用しながら学ぶ実証分析の入門書。「基礎編」は、理論的導出より EViews のシミュレーション機能を読者自らが実践することにより、計量分析を理解することに重点が置かれています。「応用編」では実際の実証分析を通して解説されています。