

## ユーザ訪問インタビュー



横浜国立大学 経済学部 小林 正人 教授

専門分野：統計科学、経済統計学

近年発表の著書・研究論文：

・ Testing the Sequential Logit Model against the Nested Logit Model Japanese  
Economic Review 60 3 345-361, 2009/09

・ Testing for volatility jumps in the stochastic volatility process Asia-Pacific Financial  
Markets 12 2 143-157 2006

今回は、横浜国立大学経済学部の小林正人先生の研究室をお訪ねしました。横浜国立大学の歴史、海外からの留学生への教育、TSP を長らく利用していた小林先生が EViews を利用するようになったきっかけなど、色々なお話を伺いました。研究室の院生の皆さんにも写真撮影にご協力いただきました。

### Excel の延長線のような使い方ができる EViews は、学生にも好評！

#### ● 今の学生の志向は「ホットな経済現象を分析する力を身につけたい」

—— 横浜国立大学経済学部の概要をお聞かせください

【小林先生】

定員は 230 名で経済システム学科と国際経済学科があります。よく経済学部と経営学部の違いを尋ねられます。現代の経済活動は企業が中心となっていますが、その外側を経済学部が分析し、その内側を経営学部が分析するのが伝統的な分類でしょうか。ただ企業の経済学、組織の経済学という学問もあり、ファイナンスは経済と経営の双方にまたがるので境界分野がどんどん発達しています。

大学院は経済学研究科ではなく、経営や法律と一緒に国際社会科学研究科という名前の組織になっています。港町・横浜にあった横浜高等商業学校が前身なので、学部には他の国立大学より国際志向が強い講義科目が並んでいます。しかし、国際化はどの大学も旗印にしていますから、最近では違いはどんどん小さくなってきていると思います。

—— 国際社会科学研究科の特徴は何でしょうか？

【小林先生】

大学院の特徴はしっかりした「コースワーク」でしょうか。私たちの分野（数学を使う経済学）では、ミクロ、マクロ、統計、計量を 1 年の前半でやり、後半で金融、ファイナンスなどの応用の勉強、2 年で修士論文の準備という体制が確立しています。

実際、こちらの（今日の取材に協力してくれた）学生たちは全員中国からの留学生です。彼らは日本で語学学校に通い、日本語を学んでから入学しました。だいたい 1 年ぐらいで日本語が話せるようになるようです。これからは海外ですでに日本語を学習した学生を直接受け入れるようなケースも増えてくると思います。

—— 計量経済学の講義を受講する学生の目的はどんな所にあるとお感じになりますか？

【小林先生】

経済学部では 2 年生から計量経済学の授業をとります。ファイナンス、国際経済学や労働経済学の履修などには計量経済の初等的な知識は必須です。

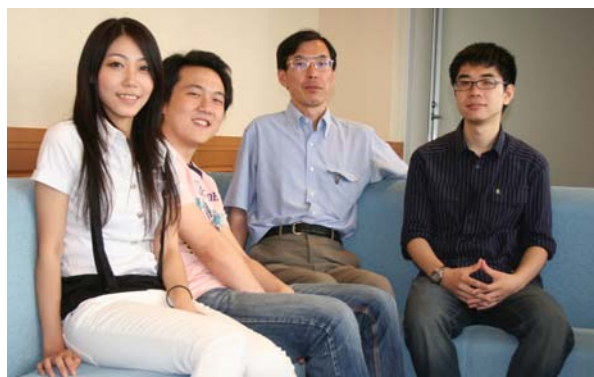
新聞やテレビ等で報道される「ホットな経済現象」をデータに基づいて分析する力を身につけたいというのが今の学生たちの志向です。その希望をうまく満たしながら、経済理論や統計理論に対する興味を引き出すのが計量経済学の講義の目的かと考えています。もちろん、そのためには経済理論をしっかり学ぶ必要があります。

—— 経済理論の学習が非常に重要だということですね

【小林先生】

目に見える「経済現象」だけでなく、実際にどのようなことが起こっているのか、その奥深いところまで理解するためには、しっかりと経済理論を学ぶ必要があります。

例えば、卵が先か鶏が先かという問題を考える場合、卵と鶏のデータが手元にあっても、どちらが先かを決めることは容易ではありません。ですから大学 2 年生の講義では、理論の勉強がまだ十分でなくてもできるような分析から行っています。そして、理論の勉強の進度に合わせて、より高度な分析へと進んでいきます。



### ● EViews を使う過程で、理論の勉強が足りない部分を補うことができる！

—— EViews を使った講義を受講する学生の皆さんの反応はいかがでしょう

【小林先生】

EViews は、Excel と同様のメニュー操作による利用、コマンドでの利用、プログラムでの利用と、利用者のレベルと用途に応じて多種の利用方法が用意されています。Excel の延長線のような使い方ができるので、抵抗感がまったくないようです。

初めは理論的に講義していたのですが、数学的な能力が原因で応用段階にたどりつく前にあきらめてしまう学生がいました。そこで、ある程度高度な手法は EViews によるデータ分析の手順とその解釈にとどめるようにしたところ、かなり高度なところまで食いついてきて、見事な修士論文を書いてくるようになりました。これは統計学のブラックボックス化とよく批判されるのですが、さまざまな分野でかなり高度な分析手法が使われているので、そのマスターのためには労力節約は仕方ないかと思います。

—— 留学生についても同じようなことが言えますか？

【小林先生】

以前、研究室にポリビアからの留学生を受け入れたことがあります。数学が苦手な彼は、研究室での勉強にかなり苦労していたようです。ところが EViews のテキストを渡してから半年ほどすると、すばらしいレポートを書いてきました。彼は今、ポリビアでエコノミストとして活躍しています。勤の良い人であれば、理論の勉強が足りなくても、EViews を使う過程で、逆に勉強の足りない部分を補うことができるようです。ブラックボックス化されていることへの是非には色々な意見があると思いますが、EViews の優れた機能の一つであると思います。

—— 先生が EViews を知ったきっかけを教えてください

【小林先生】

5~6 年前、住宅金融公庫の融資的適不適格判別のため、顧客のデフォルト確率予想モデルの作成について指導を頼まれたことがあり、現場では EViews しか使えないと

いうので、大急ぎで私も EViews を自習することになりました。それまではもっぱら TSP を利用していました。

—— EViews 導入の利点などがあれば教えてください

【小林先生】

統計ソフトには、プログラムを書いて、それを走らせ、結果を解釈するというサイクルのソフトが多いのですが、今の学生はプログラムを書いたことがなく、プログラムをどう書くか教えることに時間をとられてしまいます。

ところが EViews は、Excel の延長線のような使い方ができるので、高度な統計分析に早い段階で移行できます。Excel のワークシートのデータをそのままコピーできることも学生には好評です。統計分析の初心者にとって、データの読み込みがいちばんの難関なので、そこが容易になったことだけでも福音です。

—— EViews の特徴は情報のオブジェクト化にあります

【小林先生】

いくつもの推定結果を比較しながら作業することが多く、オブジェクトという構造の導入が大変便利です。

今までの統計ソフトだと新しい計算をする度に前の計算結果が消えてしまうので、いちいちファイルか紙にうちだして保存し、その整理に四苦八苦していたのですが、EViews ではひとつのワークファイルの中に複数の推定結果がオブジェクトとして保存できるので、呼び出しや再加工が楽になり、作業効率が格段に上がりました。

—— EViews の機能で不便だと思われるところ、今後改善を希望される機能を教えてください

【小林先生】

logit、probit で限界効果の計算結果が出力にあると解釈が楽ですので、ぜひ追加をお願いします。また、Excel からラベルの付いたデータをコピー＆ペーストするとき Empty Group の機能を利用するのですが、第 1 行目にラベル(データ名)を入力してしまう学生がかなりいます。このあたりの仕様が改善されるといいと感じます。

—— 貴重なお話を伺うことができました。ご協力ありがとうございました

### 訪問ギャラリー



緑豊かな横浜国立大学のキャンパス



小林先生と写真撮影