訳者まえがき

『入門 計量経済学』（原題 *Introduction to Econometrics 2nd ed.*）は，現実データを用いた実証分析を志すすべての人向けに書かれた，計量経済学の入門テキストです．

本書がこれまでのテキストと大きく異なるのは，具体的な応用例を通じて計量手法の内容と必要性を理解し，応用例に即した計量理論を学んでいくという，その実践的なアプローチにあります．従来のテキストでは，まず計量理論とその背後の仮定を学び，それから実証分析に進むという順番で進められます．しかし，時間をかけて学んだ理論や仮定が現実の実証問題とは必ずしも対応していないと後になって知らされることが少なくありませんでした．本書では，まず現実の問題を設定し，その答えを探るなかで必要な分析手法や計量理論，そしてその限界についても学んでいきます．また各章末には実証練習問題があり，実際にデータ分析を行って理解をさらに深めることができます．読者が自ら問題を設定して実証分析が行えるよう，実践的な観点が貫かれているのです．

本書のもう一つの重要な特徴は，初学者の自学習にも適しているということです．とても平易で丁寧な筆致が徹底されており，予備知識のない初学者であっても各議論のステップが理解できるよう言葉が尽くされています．優れたテキストに共通する特徴ですが，文字どおり「行間」が埋められているのです．翻訳においても，原文と同じく一読して頭に入るよう，読みやすく自然な訳語となるよう心がけました．分厚いテキストですが，それだけ中身がぎっしりと詰まっています．本書を粘り強く読み進めることで，読者を基礎の基礎から上級に近いレベルまで導いてくれます．

さらにもう一点付け加えると，本書は補助教材も大変充実しています．学習者用には，各章の応用例で使われるデータセットと実証結果を複製するファイル，章末の実証練習問題で使われるデータセットが用意されています．実際のデータを利用して演習を行うことで，計量分析の「実行者」としての経験を積むことができます．また，講義で本書を使われる講師の先生には，講師用リソース（パワーポイント講義ノート，練習問題の解答マニュアル）が用意されています．こうした補助教材を活用することで，本書の特徴はさらに際立ち，計量分析への理解をより深めることができるでしょう．[1]

[1]本書の補助教材は共立出版より提供されています．学習者用の補助教材については共立出版ホーム

著者の James Stock 教授（ハーバード大学）と Mark Watson 教授（プリンストン大学）は，世界第一級の計量経済学者です．訳者が著者の一人である Stock 教授と出会ったのは，1990 年の米国留学時になります．当時，訳者はハーバード大学大学院に留学し，コースワーク 1 年目に Stock 教授の上級計量経済学の講義を受講しました．それは「時系列分析（Time series analysis）」と呼ばれる計量分析に関する講義で，本書では第 IV 部で取り扱われるテーマです．時系列分析の手法は，マクロ経済やファイナンス，国際金融などの実証分析にとっていまや欠かせない標準的なツールですが，1990 年代初めはその手法が理論・応用の両面で大きく進展し，学界に広く浸透していくまさにその時期にあたります．講義では基礎から最先端まで網羅され，厳密な計量理論とともに，その手法が現実の経済や政策問題の検証にも有用であることを学びました．心が震えるような感銘を受けたことを昨日のことのように思い出します．Stock 教授の講義をきっかけに訳者は時系列分析を応用した実証研究を志すようになり，博士論文の作成では，論文改善の具体的な助言から科学的なデータ分析に対する姿勢まで指導いただきました．

世界第一級の先生による名著を日本の読者にも届けたい，そして先生から受けた学恩に少しでも報いたい，そうした思いを胸に翻訳作業を続けてきました．しかし，その道のりは平坦ではありませんでした．2003 年刊行の原著は第 2 版（2007 年）で内容が大きく拡充され，その修正作業に思いのほか時間を要しました．さらに本文パートの完成が目前となった 2010 年，訳者は日本銀行政策委員会審議委員に就任することとなり，その結果，作業スケジュールは大幅な遅延を余儀なくされました．

それでもこうして完成の日を迎えることができたのは，周囲の方々から多くのサポートやご配慮を頂戴したからこそだと感じています．祝迫得夫氏（一橋大学経済研究所）は訳者を出版社に紹介してくださり，この翻訳プロジェクトはスタートしました．柴本昌彦氏（神戸大学経済経営研究所）には，忙しい時間を割いて，章末の練習問題と付論の翻訳作業，数式変換を数多く手伝っていただき，停滞していた作業を前に進めることができました．共立出版の石井徹也氏には，プロフェッショナルな編集作業によって翻訳全般についてサポートいただき，また大幅なスケジュール遅延についても理解いただきました．そして妻と二人の娘は，まるで永遠に続くかのような作業を傍で見守り，力を与えてくれました．こうした周囲の温かい理解とサポートがなければ，原著で全 800 ページにも及ぶテキストの翻訳という膨大な仕事を完成させることはできませんでした．お世話になったすべての方々に，深く感謝申し上げる次第です．

校正を重ね，原著と訳文を何度も突き合わせては読み返し，意味の取り違えやタイプミスはないか，日本語として違和感はないか，繰り返しチェックをしました．読みやすさの観点から，必要と判断した個所には，意訳をしたり言葉を補ったりしています．各章末に

ページ（www.kyoritsu-pub.co.jp）のアフターサービス欄をご覧ください．講師用リソースについては sales@kyoritsu-pub.co.jp 宛にお問合せください．

ある「概念の復習（Review the Concepts）」は割愛しましたが，要約と練習問題が大変充実しているため，価値は損なわれないと考えています．不備がないよう最善を尽くしましたが，それでも残されている誤りがあれば，それは訳者の責任です．

最後の 18 章の校正を終了した際，まるで自分が再び米国で，あの密度の濃い恩師の講義を受け終わったかのような感覚を覚えました．本書は，計量理論をしっかり学び，実証を重んじ，そしてその限界も踏まえつつ，科学的なデータ分析に真摯に取り組むことの大切さを教えてくれます．この名著がより多くの人々に読まれ，計量経済学の楽しさと洞察の深さが広く伝わり，そして実証分析を志す人が少しでも増えたならば，訳者としてこれに勝る喜びはありません．

2016 年 3 月

宮尾 龍蔵