



学問探究一筋の細谷先生のご退任を惜しむ

細谷雄三先生は2014年3月をもって本学を定年退職されることとなります。明星大学経済学部経済学科の主要科目、統計学総論と計量経済学に加え、同大学院経済学研究科の開設当初から応用経済学専攻のコア科目である計量経済学をご担当になられて8年が経過することとなります。細谷先生は過去3年間大学院経済学研究科において研究科長職をお勤めになりましたが、ご退任に際して、僭越ながら先生の履歴、

業績を紐解き紹介しながら、祝辞を述べさせていただきますと思います。

思えば、2004年は大晦日を迎えるころであったと記憶していますが、山崎昭先生（前学部長・研究科長・現一橋大学名誉教授）に加え片岡晴夫本学名誉教授と本稿の執筆者を中心とした大学院経済学研究科設置準備委員会は、文科省への設置申請の準備期間の終盤を迎えつつある段階にあったにもかかわらず、一つの大きな

難題に直面していました。経済学研究科のミクロ経済学、マクロ経済学、計量経済学の3コア科目のうち、計量経済学の研究指導担当ポストの採用に向けて有資格の候補者を確保できない状況にあった。いろいろ検討がなされたが、極めて困難な状況にあったことは確かです。しかし最終的には、山崎先生が一橋大学の人脉を介して、当時東北大学教授であられた細谷先生を候補者として挙げていただき、東北大学における定年までのご奉職を待たずに1年前倒しで、明星大学にお呼びすることができた経緯がある。当時を振り返って山崎先生は、次のように述べておられる。「細谷先生については、理論・計量経済学の分野で国際的に最も権威のある *Econometrica* 誌の Associate Editor をされていたことがあることを存じ上げていましたので、直接に先生に連絡をとらせていただいたというのが実情です。」

先生は東京都のご出身で、芥川龍之介が通い大河内一男が学んだ名門進学校の都立両国高等学校を1962年3月に卒業後、翌月の4月東京大学文科2類に入学されました。最高学府における教育は経済学を専攻することから出発し、経済学部に進学後、1966年3月に東京大学経済学部経済学科をご卒業、翌月の4月同大学院に進学、数理統計学の重鎮である竹内啓に師事を受け1968年3月に修士課程を修了されました。その後、経済経験分析のあり方を再考・探究するために留学を決心・渡米し、イェール大学統計学研究科修士課程にご入学になられ、1970年6月に同課程を修了された。引き続きイェール大学統計学研究科博士課程に進学、4年後の1974年6月に博士課程を修了し、*Estimation problems on stationary time series models* の学位論文で統計学の Ph.D. を取得されておられます。海外での研鑽を積まれた後に1973年2月から東北大学経済学部助教授とし

て研究・教育者としての第一歩を踏み出しておられます。助教授時代（1981年9月から1年間）に、アメリカはテキサス州の Texas A&M 大学の客員教授として大学院 (Dept. of Statistics) で教鞭をとられた経験もお持ちです。

明星大学の応用経済学専攻が院生用に纏めた「平成22年ガイダンス用資料」の「経済学研究科長からの挨拶」の中で先生は次のように述べておられます。「地域から世界へと目を向け、世界から学んだことを地域へと還元する。それが明星大学ならではの地域に根付いた本経済学研究科の目標とするところです。」この訓辞は、まさに、ご自身の経験を踏まえた重い発言であろう。ただし細谷先生は、世界から学ぶだけでなく、日本という地域から世界に向けて第一級の研究成果を精力的に発信しておられ、国際学会と地域（宮城県人事委員会委員）における社会的貢献にも情熱をもって当たられている。現在は1998年から選出された *Mathematical Review* (The American Mathematical Society) の評者としての役割を果たしておられるが、15年以上にも及ぶことから、先生に対する評価と信頼度は国際的にも高いものがあることは容易に想像できる。細谷先生の研究成果と発信力は文末で記載した世界的に権威のある国際学術誌を中心とした業績（一部は紙幅の関係上割愛した）と過去の権威ある学術賞（1992年の Koopmans Econometric Theory Prize および2006年の日本統計学会賞）の受賞のご経歴からも窺い知ることができる。

そこで、以下では細谷先生のご専門の計量経済学を中心とした研究についてご紹介しておきたい。細谷教授は、特に多変量経済時系列を対象として、計量経済モデリング、統計的推定・検定・予測などのデータ分析法の開発を専門としておられる。学問分野としては執筆者自身門

外漢であるが、先生が2009年4月に上梓された訳書『経済モデルは何の役に立つのか—経済経験モデルの特定化とその評価—』(C.W.J. グレンジャー著; 牧野書店)の「訳者解説」を精読すると、この学問分野に対する細谷先生の哲学的な基本姿勢が浮かび上がってくる。先生はグレンジャーの研究に対する立ち位置を評しながら、「計量経済学において新しいアイデアが成功裡に展開する場合に、研究過程においてまずアイデアが最初に出て、数学的な精密さは後からもたらされる」と述べておられ、さらに「基本的な研究スタンスは、自分がその研究テーマに集中して取り組めるかにはなく、役に立つ研究を遂行できるかにある」(同掲80~81頁)と強調しておられる。

最後に細谷先生の思想的見地の一端を窺い知ることができる内容として、以下の論点を掲載しておこう。「経済経験分析が組織的に行われるようになったのは、ティンバーゲンによる経済理論と回帰分析に基づく景気循環分析(Tinbergen, 1939)ということができる。……しかしこれは、統計的方法を(対照ランダムによって得られたものでない)非実験データである経済データへ適用することに批判的であったケインズとの間に論争を引き起こした。経済理論家と計量経済学者との不幸な関係、非協力の関係、意志の非疎通はその後現在に至るまで続いていて、建前は経済学は経験科学のはずであるが、理論をデータで検証することは行われていない。人間の合理的経済行動についての先入観で経済現象は解明できると考えていることがむしろ経済学という学問分野の特徴であるとさえ言えよう」(前掲82頁; 下線は執筆者による)。

以上で述べてきた先生の研究と教育に対する姿勢は、明星大学の我々にとっても学ぶことが多々あり貴重な財産になった。しゃしゃり出る

ことなく、控えめで寡黙の中にも、にじみ出る温厚なお人柄と純粋で学問に対する造詣の深さには、我々教職員一同感銘を受けただけでなく、公私共々温かくご指導いただいた一人として心から感謝申し上げます。杜の都仙台に東北大学名誉教授としてお戻りになられても明星を思い出しつつ、これからも益々のご健勝とご活躍を心より祈って、贈る言葉とさせていただきます。

明星大学 経済学研究科長
上原秀樹

細谷雄三先生の主要著書と論文

著書:

『統計的証拠とその解釈—増補版—』牧野書店 2002年。
“Conditionality and maximum-likelihood estimation”

Recent Developments in Statistical Inference and Data Analysis (ed. Matusita, North Holland), pp.117-26, 1980.

“Nested statistical models and a generalized likelihood ratio test” *Statistical Theory and Data Analysis II* (ed. Matusita, North-Holland), 111-30, 1988, (with N. Terui).

“Limit theorems for statistical inference on stationary processes with strong dependence” *Statistical Sciences and Data Analysis* (ed. Matusita), pp.151-64, International Science Publishers, 1993.

“Some limit theorems on stationary processes with long-range dependence,” *Athens conference on applied probability and time series: Volume 2*, pp.233-45, 1996, eds. P.M. Robinson & R. Rosenblatt, Springer.

“Causal analysis and statistical inference on possibly non-stationary time series,” *Advances in Economics and Econometrics, 7th World Congress of Econometric Society: Volume 3, Chapter 1*, 1996, eds. D. Kreps & K.F. Wallis, Cambridge University Press.

訳書:

『時系列解析』培風館 1974 E.J. Hannan 著.

『経済モデルは何の役に立つのか—経済経験モデルの特定化と評価—』牧野書店 2009年 C.W.J.

Granger 著。
『数字で立証する—裁判と統計—』牧野書店 2012 H.
Zaisel and D.H. Kaye 著。

学術論文：

- “On the Granger condition for non-causality”
Econometrica, vol.45, no.7, pp.1735-6, 1977.
- “Discrete-time stable processes and their certain properties” *Annals of Probability*, vol.6, no.1, pp.94-105, 1978.
- “Robust linear extrapolations of second-order stationary processes” *Annals of Probability*, vol.6, no.2, pp.574-84, 1978.
- “High-order efficiency in the estimation of linear processes” *Annals of Statistics*, vol.7, no.3, pp.516-30, 1979.
- “A central limit theorem for stationary processes and the parameter estimation of linear processes” *Annals of Statistics*, vol.10, no.1, pp.132-53, 1982 (with M. Taniguchi).
- “Harmonizable stable processes” *Z. Warscheinlichkeits-theorie verw Gebiete*, 60, pp.517-33, 1982.
- “Information criteria and tests for time-series models” *Time-Series Analysis: Theory and Practice 5* (ed. O.D. Anderson, Elsevier Science), pp.39-52, 1984.
- “A simultaneous test in the presence of nested alternative hypotheses” *Journal of Applied Probability*, 23A, pp.187-200, 1986.
- “The second-order Fisher information” *Biometrika*, vol.75, no.2, pp.265-74, 1988.
- “The bracketing condition for the limit theorems of stationary linear processes” *Annals of Statistics*, vol.17, no.1, pp.401-18, 1989.
- “Hierarchical statistical model sand a generalized likelihood ratio test” *Journal of the Royal Statistical Society, Series B*, vol.51, no.3, pp.435-47, 1989.
- “Ancillarity and the limited information maximum likelihood estimation in a structural equation” *Econometric Theory*, vol.5, 385-404, 1989 (with Y. Tsukuda and N. Terui).
- “Information amount and the high-order efficiency in estimation” *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*, vol.42, no.1, pp.37-49, 1990.
- “The decomposition and measurement of the interdependency between second-order stationary processes” *Probability Theory and Related Fields*, vol.88, pp.429-44, 1991.

- “Higher-order asymptotic theory of time-series analysis” *American Mathematical Society Sugaku Expositions*, vol.4, no.2, pp.223-49, 1991 (with M. Taniguchi).
- “The quasi-likelihood approach to statistical inference on multiple time-series with long-range dependence” *Journal of Econometrics*, pp.217-36, vol.73, 1996.
- “A limit theory for long-range dependence and statistical inference on related models” *The Annals of Statistics*, vol.25, no.1, pp.105-37, 1997.
- “A note on factorization of multivariate ARMM spectra” *The Institute of Statistical Mathematics Cooperative Research Report, no.103*, pp.60-69, 1997.
- “Testing cointegration rank in the presence of structural changes” *Annual Report of the Economic Society, Tohoku University*, vol.61, no.4, pp.78-99, 2000 (with T. Takimoto).
- “Conditional asymptotic theory for near-integrated time series” *Annual Report of the Economic Society, Tohoku University*, vol.62, no.2, pp.1-26, 2000 (with T. Saito).
- “Inference on one-way effect and evidence in Japanese macroeconomic data” *Journal of Econometrics*, vol.98, no.2, pp.225-55, 2000 (with F. Yao).
- “Elimination of third-series effect and defining partial measures of causality” *Journal of Time Series Analysis*, vol.22, no.5, pp.537-54, 2001.
- “An asymptotic theory for inference on general unit-root cointegration” *Annual Report of the Economic Society, Tohoku University*, vol.64, no.3, pp.37-55, 2003.
- “A three-step procedure for estimating and testing cointegrated ARMAX models” *Japanese Economic Review*, vol.55, no.4, pp.418-450, 2004 (with T. Takimoto).
- “Testing the one-way effect in the presence of trend breaks” *Japanese Economic Review*, vol.56, no.1, pp.107-126, 2005 (with F. Yao and T. Takimoto).
- “Fractional invariance principle” *Journal of Time Series Analysis*, vol.26, no.3, pp.463-486, 2005.
- “Inference on the cointegration rank and a procedure for VARMA root-modification” *Journal of The Japan Statistical Society*, vol.36, no.2, pp.149-171, 2006 (with T. Takimoto).
- “A modified Box-Cox transformation in the multivariate ARMA model” *Journal of The Japan Statistical*

- Society*, vol.37, no.1, pp.1-24, 2007 (with T. Terasaka).
- “Inference on a set of statistical models” *Journal of The Japan Statistical Society*, vol.38, no.1, pp.107-118, 2008.
- “Inference on transformed stationary time series” *Journal of Econometrics*, vol.151, pp.129-139, 2009 (with T. Terasaka).
- “A numerical method for factorizing the rational spectral density matrix” *Journal of Time Series Analysis*, vo31, pp.229-240, 2010 (with T. Takimoto).