

〔科目名〕 実証経済分析	〔単位数〕 2単位	〔科目区分〕 専門科目 展開科目
〔担当者〕 楠山 大暁 Kusuyama Hiroaki	〔オフィス・アワー〕 時間:授業実施日の授業時間後 場所:非常勤講師控え室	〔授業の方法〕 講義および実習
〔科目の概要〕 実証経済分析は2年次科目の「統計学」と「計量経済学」に引き続き、初級から中級レベルの計量経済学的手法を学ぶ科目です。 計量経済学では、様々な現象を比例的に捉える線形回帰モデルを発展させることによって、社会経済に潜む因果効果に迫ろうとします。したがって本講義では、「Xが増えればYが増える」といったような比例的な関係が、単なる相関関係を示しているだけなのか、それとも因果関係を示しているものなのかを見極めるための計量経済学的手法を学ぶことに主眼をおきます。 そのような因果関係に迫るための手法が、重回帰分析、パネルデータ分析、操作変数法といった応用的な分析手法です。本講義では、これらのモデルに関する理論を学ぶとともに、gretlのような初心者向けのフリーソフトを用いて実際にデータ分析を行います。		
〔「授業科目群」・他の科目との関連付け〕・〔なぜ、学ぶ必要があるか・学んだことが、何に結びつくか〕 本講義は2年次科目の「統計学」と「計量経済学」の応用科目に位置づけられます。 近年、様々なデータの入手が容易になるに当たって、「エビデンスに基づく政策形成(EBPM)」の重要性が叫ばれるようになってきました。これは、多くの政策領域において、データに基づく因果関係の立証を求められていることを意味します。このようなデータに基づく因果関係の立証に必要な技術のひとつが計量経済学による実証分析です。 本講義によって、実証分析の手法をマスターできれば、専門書や学術論文の分析結果を読めるようになるだけでなく、将来的には自ら分析を行って、論文を書いたり、政策やマーケティングといった実務の現場に役立てられるようになるでしょう。		
〔科目の到達目標(最終目標・中間目標)〕 中級レベルの計量経済学的手法を習得することを目指します。その上で、自らの関心のあるテーマのデータを用いて実証分析を行い、分析結果を適確に報告できるようになることを最終的な到達目標とします。		
〔学生の「授業評価」に基づくコメント・改善・工夫〕 今年度から担当するため、該当なし		
〔教科書〕 鹿野繁樹(2015)『新しい計量経済学 データで因果関係に迫る』日本評論社		
〔指定図書〕 田中隆一(2015)『計量経済学の第一歩 実証分析のススメ』有斐閣 加藤久和(2019)『やさしい計量経済学 プログラミングなしで身につける実証分析』オーム社		
〔参考書〕 西山慶彦・新谷元嗣・川口大司・奥井亮(2019)『計量経済学』有斐閣		
〔前提科目〕 「統計学」、「計量経済学」を履修済みであることが望ましい。		

<p>〔学修の課題、評価の方法〕(テスト、レポート等) ・レポート3割 ・期末試験7割 レポートは、自ら関心のあるテーマに基づいたデータ分析の結果を報告してもらいます。 第1回目の授業で詳細を説明します。</p>	
<p>〔評価の基準及びスケール〕 レポートと期末試験の合計点に基づいて評価します。 A:80%以上 B:70%以上、80%未満 C:60%以上、70%未満 D:50%以上、60%未満 F:50%未満</p>	
<p>〔教員としてこの授業に取り組む姿勢と学生への要望〕 計量経済学の理論の習得とデータ分析の実践をバランスよく行ってほしいと思います。ぜひ、積極的に授業に臨んで下さい。</p>	
<p>〔実務経歴〕 なし</p>	
<p>授業スケジュール</p>	
第1回	<p>テーマ(何を学ぶか): インTRODクシヨン、計量経済学とはなにか? 内 容: 計量経済学の役割、基本概念の復習 教科書 第1章</p>
第2回	<p>テーマ(何を学ぶか): 確率論① 内 容: 確率変数とその分布、期待値と分散 教科書 第2章</p>
第3回	<p>テーマ(何を学ぶか): 確率論② 内 容: 正規分布、2次元の確率変数 教科書 第2章</p>
第4回	<p>テーマ(何を学ぶか): 統計的推測① 内 容: 標本平均の性質、母数の推定 教科書 第3章</p>
第5回	<p>テーマ(何を学ぶか): 統計的推測② 内 容: 母数の仮説検定 教科書 第3章</p>
第6回	<p>テーマ(何を学ぶか): 単回帰分析① 内 容: OLS回帰、単回帰によるデータ分析 教科書 第4章</p>
第7回	<p>テーマ(何を学ぶか): 単回帰分析② 内 容: 古典的回帰モデル 教科書 第5章</p>

第8回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析① 内 容:重回帰モデル、重回帰によるデータ分析</p> <p>教科書 第6章、第7章</p>
第9回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析② 内 容:回帰モデルの選定、線形制約の仮説検定</p> <p>教科書 第7章、第8章</p>
第10回	<p>テーマ(何を学ぶか):漸近理論の基礎 内 容:漸近理論、モーメント法、不均一分散に頑健な標準誤差</p> <p>教科書 第9章、第10章、第11章</p>
第11回	<p>テーマ(何を学ぶか):操作変数法① 内 容:内生性問題、操作変数法、2段階最小2乗法、操作変数によるデータ分析</p> <p>教科書 第12章</p>
第12回	<p>テーマ(何を学ぶか):操作変数法② 内 容:IV推定</p> <p>教科書 第13章</p>
第13回	<p>テーマ(何を学ぶか):実証分析のレポート作成方法 内 容:実証分析の結果のレポート作成</p> <p>教科書 配布資料による</p>
第14回	<p>テーマ(何を学ぶか):パネルデータ分析① 内 容:固定効果モデル</p> <p>教科書 第16章</p>
第15回	<p>テーマ(何を学ぶか):パネルデータ分析② 内 容:時間効果モデル</p> <p>教科書 第16章</p>
試験	<p>期末試験を実施します。</p>