

〔科目名〕 計量経済学				〔単位数〕 4 単位		〔科目区分〕 専門科目 基幹科目			
〔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〕 計量経済学は、2 年次春学期に開講された統計学で学んだことを土台として、初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。 本講義では、統計学で学んだことを復習しながら、記述統計としての最小 2 乗法を学び、線形回帰モデルによって推定された計算結果が因果関係といえる条件について議論します。また、gretl のような初心者向け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 年次春学期開講科目の「統計学」を基礎とします。また、計量経済学はこれまでに学んだミクロ経済学やマクロ経済学の理論が現実社会においても妥当性を持つかどうかを実際のデータを用いて検証することを目的とします。 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不可欠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、計量経済学的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〕 初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、分析結果を適確に解釈できるようになることを最終的な到達目標とします。									
〔ディプロマ・ポリシー (DP) との関係〕									
学部				学科					
DP1	DP2	DP3	DP4	DP1	DP2	DP3			
○		○	○		○	○			
〔学生の「授業評価」に基づくコメント・改善・工夫〕 実際に統計ソフトを用いてデータ分析を行います。									
〔教科書〕 毎回、プリントを配布します。									

〔指定図書〕 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	
〔参考書〕 岩澤政宗(2022)『計量経済学』日本評論社	
〔前提科目〕 統計学、経済統計、マイクロ経済学、マクロ経済学、情報リテラシー I	
〔学修の課題、評価の方法〕(テスト、レポート等) ・レポート課題 2 割 ・復習テスト(2 回実施)3 割 ・期末試験 5 割 レポートは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。	
〔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。	
〔実務経歴〕 なし	
授業スケジュール	
第 1 回	テーマ(何を学ぶか): イントロダクション 内 容: 計量経済学の役割 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 2 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習① 内 容: データの扱い方 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 3 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習② 内 容: 確率論 1 確率の概念 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 4 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習③ 内 容: 確率論 2 確率分布 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 5 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習④ 内 容: 確率論 3 2 つ以上の事柄の確率変数 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 6 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習⑤ 内 容: 統計的推論とは 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 7 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習⑥ 内 容: 標本平均の性質 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 8 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習⑦ 内 容: 標本分散と効率性 教科書・指定図書 授業プリントの配布
第 9 回	テーマ(何を学ぶか): 統計学の復習⑧と第 1 回～第 8 回までの復習テスト 内 容: 仮説検定 教科書・指定図書 授業プリントの配布

第 10 回	<p>テーマ(何を学ぶか):因果効果とは①</p> <p>内 容:線形回帰モデルにおける因果効果の定義</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 11 回	<p>テーマ(何を学ぶか):因果効果とは②</p> <p>内 容:線形回帰モデルにおけるパラメータを因果効果と解釈するための条件</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 12 回	<p>テーマ(何を学ぶか):単回帰分析①</p> <p>内 容:単回帰モデルと最小 2 乗法</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 13 回	<p>テーマ(何を学ぶか):単回帰分析②</p> <p>内 容:パラメータの解釈</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 14 回	<p>テーマ(何を学ぶか):単回帰分析③</p> <p>内 容:最小 2 乗推定量の性質について</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 15 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の基本①</p> <p>内 容:外的条件を制御する重回帰モデル</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 16 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の基本②</p> <p>内 容:欠落変数によるバイアス</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 17 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の基本③</p> <p>内 容: 検定</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 18 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の基本④</p> <p>内 容:大標本理論</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 19 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の応用①</p> <p>内 容:関数形の選択</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 20 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の応用②</p> <p>内 容:ダミー変数を使った分析</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 21 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の応用③</p> <p>内 容:不均一分散に頑健な標準誤差について</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 22 回	<p>テーマ(何を学ぶか):重回帰分析の応用④</p> <p>内 容:分散不均一性の検定</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 23 回	<p>テーマ(何を学ぶか):実証分析のレポート作成方法① 第 9 回～第 22 回までの復習テスト</p> <p>内 容:データの入手の仕方</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>

第 24 回	<p>テーマ(何を学ぶか):実証分析のレポート作成方法②</p> <p>内 容:実証分析の結果のレポート作成方法</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 25 回	<p>テーマ(何を学ぶか):実証分析のレポート作成方法③</p> <p>内 容:推定結果の解釈</p> <p>教科書・指定図書 授業プリントの配布</p>
第 26 回	<p>テーマ(何を学ぶか):gretl を使った実習①</p> <p>内 容:</p> <p>教科書・指定図書</p>
第 27 回	<p>テーマ(何を学ぶか):gretl を使った実習②</p> <p>内 容:</p> <p>教科書・指定図書</p>
第 28 回	<p>テーマ(何を学ぶか):gretl を使った実習③</p> <p>内 容:</p> <p>教科書・指定図書</p>
第 29 回	<p>テーマ(何を学ぶか):gretl を使った実習④</p> <p>内 容:</p> <p>教科書・指定図書</p>
第 30 回	<p>テーマ(何を学ぶか):総復習</p> <p>内 容:</p> <p>教科書・指定図書</p>
試 験	<p>期末試験を実施します。</p>