

2020年度 SYLLABUS 【博士後期課程】

授業科目名	計量経済学特別研究
担当教員名	大矢 奈美
科 目 の テ ー マ	<p>数理統計および線形代数の知識を前提に、計量経済学の理論と応用について検討する。</p> <p>経済の実証分析を信頼できるものにするためには、経済理論、数理統計、経済統計、計量経済学の知識が必要になる。ここでは、計量経済分析の基礎を確認した後、応用的手法をとりあげ、具体的な政策評価ができるような力を身につけることを目的とする。</p> <p>また、2回のレポートによって実証分析の手順を体験し、博士論文執筆の準備の1つとする。</p>
科 目 内 容 ・ 方 法 等	<p>計量経済学の理論を学ぶことはもちろん、計量分析モデルの選択、論文データの入手、推定結果の分析といった実際の分析を経験する。</p> <p>①前半（第1回～第8回） 初めに古典的回帰モデルについて確認する。また、実際に統計ソフトを用いて重回帰モデル、F検定などの分析例を受講生自身が体験する。その後、回帰分析の標準的仮定が維持されないケースについてとりあげ、系列相関、不均一分散、同時方程式モデルなどについて学ぶ。前半終了時には中間レポートの提出を課す。</p> <p>②後半(第9回以降) 主に労働経済・社会保障の分野の実証分析をとりあげながら、質的選択モデルを解説する。具体的には、logit・probit分析を中心に、雇用政策の効果に関する実証分析や公的年金が就業選択に与える影響などの例を紹介し、実習をおこなう。また、パネルデータ分析なども取り扱う。後半終了時には、全体を通したレポート課題の提出を課す。</p> <p>評価は2つのレポート課題によっておこなうこととする。</p> <p>なお、テキストおよび科目内容は受講生の理解度および問題意識に応じて、変更することがあるので、受講を希望する場合は事前に問い合わせること。</p> <p>教科書、参考書： <ul style="list-style-type: none"> ・Greene, W.H. <i>Econometric Analysis</i>, 7th ed. Pearson. 2011. ・末石直也 (2015), 計量経済学—マイクロデータ分析へのいざない, 日本評論社. </p>