

2022年度 SYLLABUS 【博士前期課程】

授業科目名： 計量経済学特論	
担当教員名： 大矢 奈美	
授業科目概要： 計量経済学は、統計的な分析によって、マクロ経済学やミクロ経済学などの理論を現実の経済に応用するための手段である。コンピュータが発達した現在では、高度な数学や統計的な知識を意識せずに利用することができ、経済にとどまらず広い分野で使われている。ここでは統計ソフトを用い、実践的な計量経済学を扱うこととする。 ただし、仮説や分析モデルの構築、推定結果の評価はコンピュータで代替できるものではない。単なる「計算」ではなく、あくまでも計量経済分析の考え方・方法を身につけることが目的である。	
履修上の留意事項： 受講希望者は必ず事前にメールで問い合わせること。前提科目として、統計学特論（最低でも学部での統計学）の履修を勧める。 履修証明プログラム受講生は、春学期必修科目を履修済みの上で受講すること。 テキストの正式な指定は、受講生の研究計画を確認してからおこなう。ただし、受講生の研究計画により、時系列分析もしくはマイクロデータ分析を重点的に取り扱うことが必要であると判断した場合には、全受講生と相談の上、テキストおよび授業計画を変更する。 マクロ経済学・ミクロ経済学および統計学の基礎的な知識があることを前提とするが、これらに自信がない場合は参考書などを使って自習して欲しい。	
教科書・参考書（参考文献）	
教科書 書名： 計量経済学 著者／編者： 西山・新谷・川口・奥井 出版社： 有斐閣 出版年： 2019年	書名： 著者／編者： 出版社： 出版年：
参考書 1 書名： やさしい計量経済学 著者／編者： 加藤久和 出版社： オーム社 出版年： 2019年	書名： 著者／編者： 出版社： 出版年：
参考書 2 書名： 計量経済学の第一歩 著者／編者： 田中隆一 出版社： 有斐閣 出版年： 2015年	書名： 著者／編者： 出版社： 出版年：
評価方法及び判定基準： 授業内の課題（平常点）50点、最終レポート50点の計100点で評価する。 Aは80点以上、Bは70点以上、Cは60点以上、Fは60点未満とする。	
授業目標及び進め方： 自らの問題意識にもとづき、モデル構築、データ収集、推定、分析、考察ができるようになることが最終的な目標である。このため、適宜コンピュータによる実習をまじえて進める。（実習はgretlを用いる予定である。） ただし受講生の理解度によって、授業計画は変更する可能性がある。	

第 1 回	テーマ：復習：統計学（1） 内 容：データの整理と確率変数 教科書／参考書：教科書・第 2 章
第 2 回	テーマ：復習：統計学（2） 内 容：統計理論の基礎 教科書／参考書：教科書・第 3 章
第 3 回	テーマ：線形単回帰モデルの推定と検定（1） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第 4 章
第 4 回	テーマ：線形単回帰モデルの推定と検定（2） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第 4 章
第 5 回	テーマ：重回帰モデルの推定と検定（1） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第 5 章
第 6 回	テーマ：重回帰モデルの推定と検定（2） 内 容：複数の制約からなる仮説の検定 教科書／参考書：教科書・第 5 章
第 7 回	テーマ：これまでの内容の確認 内 容： 教科書／参考書
第 8 回	テーマ：パネルデータ分析（1） 内 容：固定効果モデル 教科書／参考書：教科書・第 6 章
第 9 回	テーマ：パネルデータ分析（2） 内 容：1 階差分変換 教科書／参考書：教科書・第 6 章
第10回	テーマ：パネルデータ分析（3） 内 容：変量効果モデル 教科書／参考書：教科書・第 6 章
第11回	テーマ：操作変数法（1） 内 容：欠落変数バイアスと操作変数 教科書／参考書：教科書・第 7 章
第12回	テーマ：操作変数法（2） 内 容：2 段階最小乗法 教科書／参考書：教科書・第 7 章
第13回	テーマ：ロジットモデルとプロビットモデル 内 容： 教科書／参考書：教科書・第 8 章
第14回	テーマ：時系列モデル分析 内 容：系列相関がある場合の分析 教科書／参考書：教科書・第10章
第15回	テーマ：時系列モデル分析（2） 内 容：トレンドと構造変化 教科書／参考書：教科書・第11章