

中級計量経済学・応用計量経済学
平成 24 年度後期

教員: 西山慶彦
研究室: 総合 2 号館 458 号室
E-mail: nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp
オフィスアワー: 木曜日 11:00-12:00

時間と場所: 金曜日 1 限 (8:45-10:15) 法経東館 311 演習室.

講義の概要と目的: 計量経済学の基礎知識を学習する。特に、経済学の実証分析の論文を読んで理解できる程度の知識を得ることを目的とする。

計量経済学の初学者を対象とする。自身の研究では大がかりな計量分析を行わないが実証分析の論文を読む必要がある大学院生、卒業論文で実証分析を行う予定の学部生を想定している。博士後期課程に進学して実証研究を行う予定の大学院生は、かわりに上級計量経済学をとることを薦める。

本講義では、できるだけ多くの計量経済学の主な分野を(浅くではあるが)扱う予定である。また本講義で扱わない内容のうち、計量ファイナンスと計量経済学の実習については、年度末(2~3月)に非常勤講師による講義が予定されている。

なお、宿題で表計算ソフトと統計ソフトを使用するが、そういったソフトの使用方法は自学する必要がある。なお、宿題はエクセルでできる程度の出題を予定している。

履修要件: 中級統計学の履修、あるいはそれに相当する統計学の知識。線形代数の基礎知識があることが望ましい。

教科書: Stock, J. and M. Watson (2011): "Introduction to Econometrics," 3rd International edition, Pearson Education Limited, ISBN 978-1408264331.

なお、講義は必ずしも教科書どおりには進まないが、教科書は購入することを勧める。宿題は教科書から出題される場合もある。

参考書: この講義は中級統計学の履修に相当する統計学の知識を前提としている。その水準の統計学の自習のためには、次の本が参考になる。

- 片山直也『実例と EXCEL による統計学トレーニング』牧野書店、2009年

次の本は採用書と並ぶ、英文の計量経済学の標準的な教科書である。

- Wooldridge, Jeffrey (2008): "Introductory Econometrics," international edition of 4th revised edition, South-Western, ISBN 978-0324788907.

講義内容よりも高度な内容に興味のある場合は、例えば次のような本が役に立つと思われる。

- 北村行伸『ミクロ計量経済学入門』日本評論社、2009年
- 沖本竜義『経済・ファイナンスデータの計量時系列分析』朝倉書店、2010年

質問: 授業内容に関する質問は、オフィスアワーか、授業時間内に行うこと。

ウェブ: 授業の資料は、HP を通じて配布される予定である。詳細については、後日連絡する。

TA: 吉村有博 (yoshimura.a@hy2.ecs.kyoto-u.ac.jp)
主な業務は宿題の採点である。

成績評価の方法・基準:

宿題 (20%): 3 回程度。

中間試験 (30%): 11 月 30 日金曜日の 1 限 (授業時間中) に行う予定である (進度によって変更の可能性あり)。試験範囲は、回帰理論と操作変数法を目安とするが、試験前に正確な範囲を連絡する。持ち込み不可。プログラム機能のない電卓は使用可能。

期末試験 (50%): 時間と場所は学期末に授業中、および事務を通じて連絡。持ち込み不可。プログラム機能のない電卓は使用可能。試験範囲は授業内容すべて。

授業計画 計画は変更される可能性がある。中間試験の日程は授業中に連絡するので、単位を取得する予定の出席者は注意すること。なお、以下には教科書の該当箇所を記しているが、試験などは、講義ノートの内容に準拠して行う予定である。

授業予定 10月5日	授業の紹介、数学の準備	教科書第18章
10月12日	数学の準備の続き	教科書第18章
10月19日	回帰分析	教科書第4,5,6,7章
10月26日	回帰分析の続き	教科書第8,9,17,18章
11月2日	操作変数法	教科書第12章
11月9日	操作変数法の続き	教科書第12,13章
11月30日	中間試験	これまでの講義内容から出題
12月7日	パネルデータ	教科書第10章
12月14日	パネルデータの続き	教科書第10,13章
12月21日	2項選択モデル	教科書第11章
1月11日	時系列分析の基礎	教科書第14章
1月25日	自己回帰移動平均モデル	教科書第14,15章

11月16日は海外出張のために休講とする。