

平成 24 年度 計量経済学特別講義

以下の特別講義を開講します。単位や成績とは無関係ですが、修士論文執筆の参考となる最先端の内容やテクニックが含まれています。興味のある人は是非参加してください。レベルは計量経済学を一通り勉強した大学院修士向けですが、学部生、博士課程院生その他、どなたでも参加して頂いて結構です。

I) 高頻度資産価格データ分析

講師： 大屋幸輔先生（大阪大学教授）

内容： 近年急速に重要性が増している金融データの計量分析の手法と実際について講義します。特に、高頻度金融データ、マーケットマイクロストラクチャー、ボラティリティなどの最先端トピックを取り扱います。

日時： 2月26日（火）13:00～14:30、14:45～16:15

場所： 経済研究所第二会議室（総合研究2号館4F）

II) Eviews を使った実証分析

講師： 小西葉子先生（経済産業研究所研究員）

内容： Eviews を実際に使いながら各種推定、検定方法を実習形式で学びます。具体的なトピックとしては、クロスセクション分析（誤差項の正規性、不均一分散、関数形）、パネル分析（ハウスマン検定）、二値選択分析（ロジット、プロビット）等を予定しています。

日時： 3月12日（火）13:00～17:00（途中休憩有り）

場所： 情報演習室1（経済学研究科地下）

問合せ：何か質問等あれば、西山(nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp) までご連絡ください。