

# 平成 26 年度 計量経済学特別講義

## ～ 時系列分析入門 ～

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、学位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。特にマクロ経済実証、金融時系列分析には有効なモデルや分析手法の解説です。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、博士課程大学院生その他、どなたでも参加して頂いて結構です。興味のある人は是非参加してください。

### 時系列分析入門

講師： 谷崎久志先生（大阪大学経済学研究科教授）

内容： 経済で特有の時系列分析は、VAR モデル，因果関係，インパルス応答関数，単位根，見せかけ回帰，共和分などが挙げられる。定常時系列から非定常時系列まで，経済時系列分析の方法を講義する。

日時： 2月6日（金）

13:00~14:30 入門時系列モデル

14:45~16:15 VAR(vector Auto Regression)モデル分析

2月13日（金）

14:45~16:15 単位根・共和分分析

場所： 経済研究所 第一共同研究室（経済研究所本館 4F）

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。