

平成 28 年度 計量経済学特別講義

①時系列データを用いたフィリップス曲線と簡単な DSGE モデルの推定

②ノンパラメトリック回帰の基礎

以下の 2 件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。①はマクロ時系列分析で近年よく用いられる手法です。②はマイクロ経済実証に有効なモデル・分析手法で、線形回帰のように関数形を定めずに回帰分析を行う手法の解説です。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。

①時系列データを用いたフィリップス曲線と簡単な DSGE モデルの推定

講師： 新谷元嗣先生（東京大学先端科学技術センター教授）

日時： 2月9日（木） 2、3限目

場所： 経済研究所 第一共同研究室（経済研究所本館 4F）

内容： 時系列分析の手法を用いて、貨幣的な現象を表すインフレ率と実質的な経済活動である生産量を結ぶ関係式であるフィリップス曲線を推定する方法を説明する。前半ではフィリップス曲線の推定に必要な変数であるインフレギャップや GDP ギャップの統計的な性質を議論する。後半では現代的なフィリップス曲線であるニューケインジアン・フィリップス曲線（NKPC）を取り上げて、NKPC を含むマクロモデルである DSGE モデルの推定や、NKPC の派生形である一般化ニューケインジアン・フィリップス曲線（GNKPC）の推定についても解説する。

② ノンパラメトリック回帰の基礎

講師： 末石直也先生（神戸大学経済学研究科准教授）

日時： 2月10日（金） 2～4限目

場所： 経済研究所 第一共同研究室（経済研究所本館 4F）

内容： 実証研究で回帰関数を推定する際、経済理論から関数形が示唆されることは稀である。本講義では、関数形の仮定を置かずに回帰関数を推定する方法であるノンパラメトリック法について概説する。特に、カーネルを用いた推定量である Nadaraya-Watson 推定量と local linear 推定量と、基底関数を用いたシリーズ推定量について解説する予定である。

問合せ： 質問などがあれば、西山(nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp)までご連絡ください。