

中級計量経済学・応用計量経済学
平成 29 年度後期

教員: 西山慶彦
研究室: 経済研究所 311 号室
E-mail: nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp
オフィスアワー: 金曜日 11:00-12:00 (email でアポイントメントを取ること)

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

講義の概要と目的: 計量経済分析とは、統計的手法を用いて経済理論に現れる未知の量をデータから求める(推定)、あるいは経済理論がデータに照らして正しいと言えるか確かめる(検定)ことである。

この授業では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本格的な実証研究を行う予定の大学院生は、上級計量経済学の履修が望ましい。

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少し進んだトピックとして、年度末(2~3月)に非常勤講師による1~2日での集中講義を予定している。内容は非定常マクロ時系列解析とその応用を予定しており、詳細は後日周知する。

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こと。なお、宿題はエクセルでできる程度の問題を予定している。

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。

授業内容: 回帰分析、操作変数法、パネルデータ分析、二値選択モデル、時系列モデル

教科書: Stock, J. and M. Watson (2014): "Introduction to Econometrics, Update," Pearson Education Limited; Global ed of 3rd revised ed 版, ISBN 978-1292071312.

なお、講義中に教科書の参照が必要になることはないが、実証研究に興味がある学生は購入することを勧める。

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 (2013): "Introductory Econometrics," international edition of 5th revised edition, ISBN 978-11115343947.

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。

- 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、授業時間内またはオフィスアワーに行うこと。

講義ノート： 授業の資料は、以下の HP を通じて順次配布する。

<http://www.nishiyama.kier.kyoto-u.ac.jp/jyugyo2017.html>

TA： 坂口翔政 (s.shosei@gmail.com)

宿題の採点と返却時の解説を担当してもらう。

成績評価の方法・基準：

宿題 (20%)： 2 回程度。

中間試験 (30%)： 11 月 21 日 (火) 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 およそ以下のように進める。11/21 に中間試験を実施予定であるが、進度によって変更する。試験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 3 日	授業の紹介と回帰分析導入	
10 月 10 日	回帰分析	教科書第 4,5,6,7 章
10 月 17 日	回帰分析の続き	教科書第 8,9,17,18 章
10 月 24 日	操作変数法	教科書第 12 章
11 月 7 日	操作変数法の続き	教科書第 12,13 章
11 月 14 日	操作変数法の続き	教科書第 12,13 章
11 月 21 日	中間試験	これまでの講義内容から出題
11 月 28 日	パネルデータ	教科書第 10 章
12 月 5 日	パネルデータの続き	教科書第 10,13 章
12 月 12 日	2 項選択モデル	教科書第 11 章
12 月 19 日	自己回帰移動平均モデル	教科書第 14,15 章
12 月 26 日	自己回帰移動平均モデル	教科書第 14,15 章
1 月 9 日	期末試験	これまで全ての内容が出題範囲