

# 令和元年度 計量経済学特別講義

## ～ 高次元データ分析入門 ～

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。主として、高次元データを分析するための手法を解説します。高次元データの分析は、機械学習や人工知能（AI）の構築に深く関係する基礎理論で、現在計量経済学のみならず統計学で最も研究が盛んに行われている分野のひとつです。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。

講師： 末石 直也先生（神戸大学経済学研究科教授）

日時： 3月3日（火） 3、4限目  
3月4日（水） 3、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： 本講義では、高次元データと呼ばれるサンプルサイズに比較して変数の数が多いデータを分析するための手法について解説します。はじめに、AIC や BIC などの情報量規準に基づく古典的な変数選択法について解説します。その後、古典的な変数選択法が抱える問題点の解決策として、LASSO に代表される正則化法をいくつか紹介します。さらに、高次元時系列データの分析方法の一つであるファクターモデルを用いた分析方法を紹介します。

問合せ： 西山(nishiyama@kier.kyoto-u.ac.jp)までご連絡ください。