

中級計量経済学
令和2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:

今年度は covid19 の影響のため、pdf ファイルと音声ファイルによる配信授業とする。

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理論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。内容はミクロ計量経済分析の最新の理論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、レポートで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。それらについては、結果のみ講義ノート1にまとめてあるので、復習に使われたい。

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、履修において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、比較的単純なものはメールで、込み入った内容であれば email でアポイントメントを取って面談で行うこと。

講義ノート: 授業の資料は、PandA を通じて順次配布する。

成績評価の方法・基準: 以下の2回のレポートにより評価を行う。

- 中間レポート (40%): 11月を予定
- 期末レポート (60%): 1月を予定

いずれも授業の資料と同じく PandA を通じて配布する。