

令和二年度 計量経済学特別講義

～定常・非定常時系列分析と構造変化～

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、時系列データを分析するための手法を解説します。経済時系列データの分析を念頭に、定常時系列および非定常時系列分析の手法についての解説です。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。

講師： 黒住 英司先生(一橋大学経済学研究科教授)

日時： 2月16日(火) 3、4 限目
2月17日(水) 2 限目

方法： オンラインZoomにて開講

(ご参加の方は2月8日(月)までに寺沢まで
<terasawa@kier.kyoto-u.ac.jp> ご返信を頂きたいいたします。
後日ZoomのURLをご送付いたします。)

内容： 本講義では、経済時系列データの分析を念頭に、定常時系列および非定常時系列分析の手法について解説をします。まず、はじめに、時系列分析について必要な概念の定義を行った上で、代表的な定常モデルとその推定・検定方法について説明します。その上で、非定常時系列モデルとして実証分析によく用いられる、トレンド定常モデル、単位根モデル、共和分回帰モデル、構造変化モデルを取り上げて、各々の特性について解説をします。

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