

平成 30 年度 計量経済学特別講義

～ 非定常時系列分析入門 ～

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。マクロ経済実証、金融時系列分析に有効なモデルや分析手法の解説です。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。

講師： 松木隆先生（大阪学院大学経済学部教授）

日時： 3月13日（水） 14:00～15:30
3月14日（木） 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： 本講義では主としてマクロ経済実証分析、金融計量経済分析において非常によく用いられ非定常時系列分析を紹介します。近年増えつつある非定常パネルデータの分析法についても触れます。

1. 単位根検定の理論と実証

- 基本的な検定（Dickey-Fuller 検定と Phillips-Perron 検定）
- その他の単位根検定（DF-GLS、定常性検定、構造変化を考慮した検定、パネル単位根検定など）
- 単位根検定を用いた実証分析紹介（Nelson and Plosser (1982)の実証例、購買力平価説や1人当たり所得コンバージェンスの検証など）

2. 共和分検定の理論と実証

- 共和分と共和分システム
- 共和分検定（回帰残差に基づく検定、Dynamic OLS、Fully modified OLS、ヨハンセン検定、パネル共和分検定など）
- 共和分検定を用いた実証分析紹介（貨幣需要関数の推計、効率的市場仮説の検証、金融市場の連動性の分析など）

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