

2026年度 SYLLABUS 【博士前期課程】

授業科目名：計量経済学特論		専修：経済専修
担当教員名：大矢 奈美		科目区分：基幹科目
<p>授業科目概要：</p> <p>計量経済学は、統計的な分析によって、経済理論を現実の経済に応用するための手段である。コンピュータの発達により、高度な数学や統計的な知識を意識せずに利用することができ、経済にとどまらず広い分野で使われている。ここでは統計ソフトを用い、実践的な計量経済学を扱うこととする。ただし、仮説や分析モデルの構築、推定結果の評価はコンピュータで代替できるものではない。単なる「計算」ではなく、あくまでも計量経済分析の考え方・方法を身につけることが目的である。</p>		
<p>履修上の留意事項：</p> <p><u>前提科目として、統計学特論（最低でも学部の統計学）の履修を勧める。</u></p> <p><u>履修証明プログラム受講生は、春学期必修科目を履修済みの上で受講すること。</u></p> <p>テキストの正式な指定は、受講生の研究計画を確認してからおこなう。ただし、受講生の研究計画により、時系列分析もしくはマイクロデータ分析を重点的に取り扱うことが必要であると判断した場合には、全受講生と相談の上、テキストおよび授業計画を変更する。マクロ経済学・マイクロ経済学および統計学の基礎的な知識があることを前提とするが、これらに自信がない場合は参考書などを使って自習して欲しい</p>		
教科書・参考書（参考文献）		
教科書	書名	書名
書名	：計量経済学	著者／編者
著者／編者	：西山・新谷・川口・奥井	出版社
出版社	：有斐閣	出版年
出版年	：2019年	
参考書 1	書名	参考書 2
書名	：やさしい計量経済学	書名
著者／編者	：加藤久和	著者／編者
出版社	：オーム社	出版社
出版年	：2019年	出版年
		：2015年
ディプロマ・ポリシー（DP）との関係		
DP1	DP2	DP3
○	○	
<p>到達目標：</p> <ul style="list-style-type: none"> 計量経済学の中級レベルの手法について理解する 自らの問題意識にもとづき、モデル構築、データ収集、推定、分析、考察ができる 		
<p>評価方法及び評価基準：</p> <p>毎回の練習問題の取り組み状況（3割程度）、最終レポートの完成度によって、研究科の成績評価基準に照らして評価を行う。</p> <p>最終レポートでは、授業内で取り扱った分析手法による計量分析が課題となる予定。仮説設定、分析、結果の解釈、考察および仮説への回答の一連のプロセスを内容とする。</p>		
<p>授業の方法：</p> <p>講義と受講生による練習問題の発表。随時、統計ソフト（gretlを予定）を用いた実習を行う。</p>		

第1回	テーマ：復習：統計学（1） 内 容：データの整理と確率変数 教科書／参考書：教科書・第2章
第2回	テーマ：復習：統計学（2） 内 容：統計理論の基礎 教科書／参考書：教科書・第3章
第3回	テーマ：線形単回帰モデルの推定と検定（1） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第4章
第4回	テーマ：線形単回帰モデルの推定と検定（2） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第4章
第5回	テーマ：重回帰モデルの推定と検定（1） 内 容： 教科書／参考書：教科書・第5章
第6回	テーマ：重回帰モデルの推定と検定（2） 内 容：複数の制約からなる仮説の検定 教科書／参考書：教科書・第5章
第7回	テーマ：これまでの内容の確認 内 容： 教科書／参考書
第8回	テーマ：パネルデータ分析（1） 内 容：固定効果モデル 教科書／参考書：教科書・第6章
第9回	テーマ：パネルデータ分析（2） 内 容：1階差分変換 教科書／参考書：教科書・第6章
第10回	テーマ：パネルデータ分析（3） 内 容：変量効果モデル 教科書／参考書：教科書・第6章
第11回	テーマ：操作変数法（1） 内 容：欠落変数バイアスと操作変数 教科書／参考書：教科書・第7章
第12回	テーマ：操作変数法（2） 内 容：2段階最小乗法 教科書／参考書：教科書・第7章
第13回	テーマ：ロジットモデルとプロビットモデル 内 容： 教科書／参考書：教科書・第8章
第14回	テーマ：時系列モデル分析 内 容：系列相関がある場合の分析 教科書／参考書：教科書・第10章
第15回	テーマ：時系列モデル分析（2） 内 容：トレンドと構造変化 教科書／参考書：教科書・第11章