

時間割番号: 2351000008

専門演習 I

担当教員

得田 雅章[Masaaki Tokuda]

開講学部等	経済学部	対象年次	3~4	単位数	2
開講時期	春学期	開講曜時	水3	クラス	

授業の目的と概要

テキストの輪読を通じて、古典的線形回帰モデルの諸仮定に関する理解を深め、仮定が満たされなかった場合の対処法について学んでもらう。加えて、同時方程式およびVAR（ベクトル自己回帰）を用いたモデルビルディングに習熟してもらい、シミュレーションや予測に活用してもらおう。スタイルはPC教室での輪読および実習形式である。ソフトは主にEViewsを用いるが、MS Excelも適時利用する。主にマクロ経済データを利用し、計量分析の意義や適用可能性についても伝えていく所存である。

テキスト輪読後は、卒業論文に関する指導を行なう。

具体的かつ社会的意義のある研究計画書を仕上げるのが第一義であるが、アウトラインに沿った修士論文になるべく近い形での期末レポート作成を促す。

授業の到達目標

授業の到達目標（必須）

就職活動時に十分なアピールができるよう、前倒して卒論に関する取り組みを始めてもらいます。

専門演習 I での目標は3つ。

1. 難解な証明めきに、テキスト記載の基本的な内容を理解すること。
2. 計量分析ソフトEViewsの基礎操作をマスターすること
3. 期末レポート20枚相当を卒業論文のドラフト（草稿）として執筆すること。
「タイトル」、「分析手法」、「分析領域」を確定し、数件の先行研究と簡単な実証分析をまとめてもらいます。
※本学夏季懸賞論文への投稿を目指します。

授業計画

回 内容

01 インTRODクシヨン：計量経済学とは何か、報告順番決定、EViews取扱い基礎
(02~11はテキストの各章に対応)

02 Simple Regression

03 Multiple Regression

04 Multicollinearity

05 Heteroskedasticity

06 Autocorrelation

07 Misspecification

08 Simultaneous Equation Models

09 VAR Models and Causality Tests

10 Non-Stationarity and Unit-Root Tests

11 Cointegration and Error-Correction Models

12 受講生各自オリジナル分析展開①

13 受講生各自オリジナル分析展開②

14 講義総括

※1 輪読報告終了後、卒業論文に関する研究指導を行なう。

※2 このスケジュールはあくまでも予定であり、適時修正される可能性がある。毎回の講義で確認してください。

授業計画の補足（事前学習・事後学習など授業時間外の学習、参考資料など）

- ・テキスト各章は20~30ページです。報告者は各章の内容を、数ページのハンドアウト（レジユメ）にまとめる能力が要求されます。
- ・報告・輪読はプレゼン形式で行い、人前で話すことにも慣れてもらいます。

・報告者は、エクササイズとしてテキスト記載のEViews画面と同じ結果が出せるかについても確認してもらいます（皆をリードする）。

成績評価の方法

- ・原則毎回出席
- ・輪読報告50%
- ・質問に対する対応・ディスカッションへの貢献度20%
- ・期末レポート30%

をもとに総合的に評価する。

成績評価の基準

- ・原則毎回出席：欠席や遅刻の程度に応じて、評価を最大20%削減します。
- ・輪読報告：プレゼン資料の準備・クオリティ・時間配分を評価します。
- ・質問に対する対応・ディスカッションへの貢献度20%：輪読箇所の読み込み、報告者・教員からの質問に対する的確な対応ができていないか評価します。
- ・期末レポート30%：卒業論文ドラフトの完成度（20枚以上が望ましい）

教科書

教科書1	ISBN	1137415460				
	書名	Applied Econometrics (3rd edition)				
	著者名	Dimitrios Asteriou and Stephen G. Hall	出版社	Palgrave Macmillan	出版年	2015

参考書

参考書1	ISBN	4915787451				
	書名	計量経済学				
	著者名	山本拓著,	出版社	新世社	出版年	

参考書2	ISBN	4811543122				
	書名	計量経済学				
	著者名	藁谷千凰彦著,	出版社	多賀出版	出版年	2003-04

参考書3	ISBN	4492814515				
	書名	計量経済学				
	著者名	藁谷千凰彦著,	出版社	東洋経済新報社	出版年	1997-04

参考書4	ISBN	4535554374				
	書名	EViewsによる経済予測とシミュレーション入門				
	著者名	飯塚信夫,飯塚, 信夫,加藤, 久和,	出版社	日本評論社	出版年	2006-10

参考書5	ISBN	4535554978				
	書名	例題で学ぶ初歩からの計量経済学				
	著者名	白砂堤津耶著,白砂, 堤津耶(1957-),	出版社	日本評論社	出版年	2007-03

教材に関する補足情報

教科書については、ゼミ生の興味や能力を考慮し、適宜変更する可能性があります。

参考文献一覧

参考書ほか：

- ・EViews Manual（日本語マニュアルは情報処理センター受付で借りられます）

活用が期待されるウェブサイト：

総務省統計局
日本銀行 統計・データ
数学ナビゲーター
等

■ ■ 履修上の注意事項

1. 講義には作成したファイルを保存できるUSBメモリ等、ストレージデバイスを用意しておいてください。また、前回までに使用・作成したファイルも持ってきてください。
実習という性格上、隣前後の人との話はある程度認めます。わからないこと、アドバイス等、積極的にコミュニケーションをとりましょう。
2. エクセル操作の熟達
ゼミで使用する計量分析ソフトはEViewsですが、データの収集や整理の過程ではエクセルを活用します。必要最低限の操作法は講義中に教えますが、エクセル初心者はある程度、自分で学習したほうが講義での効率は格段に上がります。

■ ■ キーワード（「実務経験のある教員による授業科目」は「実務経験」で検索）

マクロ経済モデル、データ分析、予測、政策シミュレーション

■ ■ 備考（実務経験の内容と授業との関連を含む）

研究室：402B

“自ら”問題点を発見→分析→報告→議論、を繰り返す中で優れた論文が出来上がります。この一連の過程を習熟することで立派な社会人としての素養が身に付くでしょう。本ゼミに参加する学生にはそのためのバックアップを惜しみません。

■ ■ 参照ホームページ

<https://www.biwako.shiga-u.ac.jp/sensei/m-tokuda/>

■ ■ 教員からの一言

■ ■ オフィスアワー

火曜日の昼休み（12：00～12：50）

■ ■ 連絡先（研究室他）

402B室

■ ■ 連絡先（電話番号）

■ ■ 連絡先（メールアドレス）

m-tokuda@biwako.shiga-u.ac.jp

■ ■ ホームページ

<http://www.biwako.shiga-u.ac.jp/sensei/m-tokuda/>

■ ■ 備考（教員情報）

電子メールにて