

計量経済学Ⅱ(自主ゼミ)

➤ 概要

主催者：野田ゼミ4回生 吉田旺彦 上岡夏樹

開講曜日：月曜4限

開講場所：情報処理センター第4演習室

受講条件：野田ゼミ3回生、もしくは「計量経済学Ⅰ」の成績80点以上の者

受講定員：20名(先着順)

➤ 講義の目的

「計量経済学Ⅰ」で学習した回帰分析は、実際のデータに活用することはできない。最小2乗法は6つの仮定の上で成立しており、それら6つの仮定が全て満たされているデータなどそうそうないからである。そういった推計における問題にどのように対処すべきかを伝えることが第一の目的となる。

第二の目的は、受講生の卒論において行う実証分析の準備をすることである。今はまだどのような研究にするか決めている者は少ないはずだし、分析手法まで確立している者はおそらくいないだろう。研究内容を決めた時に、どのようにそれを分析するか、どの手法を用いることができるか、分析手法の引き出しを増やし、自ら新しい手法を探す力を培うことを第二の目的とする。

そして最も重要となるのが、計量分析の面白さを伝えることである。ヒトは未知のものについて知る時に知的な好奇心を働かせ、知識として吸収し実践に役立てた時にこの上ない喜びを感じる。計量分析においても例外ではない。受講生の知的な好奇心を刺激し、より深く自ら計量分析を学んでいけるように、計量分析の面白さを伝えていくことが第三の目的である。

➤ 到達目標

理論と実践の面で以下のように定める。

1. 理論

- ・6つの仮定が満たされない時の対処法の理解

2. 実践

- ・データを正しく扱う力を付ける
- ・計量ソフトによるモデルの推計と結果の表現

➤ 授業計画

- 0 1 イントロダクション・不均一分散 (1)
- 0 2 不均一分散 (2)
- 0 3 不均一分散 (3)
- 0 4 系列相関 (1)
- 0 5 系列相関 (2)
- 0 6 被説明変数と誤差項の相関 (1)
- 0 7 被説明変数と誤差項の相関 (2)
- 0 8 同時方程式モデル (1)
- 0 9 同時方程式モデル (2)
- 1 0 その他の問題 (1) 多重共線性
- 1 1 その他の問題 (2) 過小定式化
- 1 2 初級から中級へ (1) 質的選択モデルとトービットモデル
- 1 3 初級から中級へ (2) イベントスタディにおける Chow 検定
- 1 4 総括と期末レポートについて

➤ 成績評価

平常点 20 点、課題 30 点、期末レポート 50 点の 100 点満点で評価する。

復習したかを確認するために回答を求めることがあるが、質によって加点を行う。明らかな怠慢があれば減点も行う。

➤ 受講上の注意

- ・専門性が強いので毎回予習することを推奨する
- ・復習を前提としているため課題を毎回出題する
- ・作業中は受講生同士のコミュニケーションを認めるが解説中は私語を慎むこと
- ・やる気がないと判断した生徒は以降の受講を禁止する
- ・自主ゼミであるため成績評価はあっても単位は降りない
- ・成績はゼミ教員に報告する

➤ 教科書

I で使用したものをそのまま使用する。適宜補助教材として大学図書館内にあるものを参考書として指定する。

➤ 講義資料

毎回前日には共有ファイルに追加しておくので、各自授業前にダウンロードしておくこと。

➤ 連絡先

E-mail : s2014348@st.shiga-u.ac.jp