

「計量経済分析」講義予定

一橋大学国際・公共政策大学院・2006年度・前期

曜日時限：水曜 1 限（8:50～10:20）、金曜 1 限（8:50～10:20）

教室：マーキュリータワー6階 3610

担当：別所俊一郎（第2研究館 211、内線 8587、bessho <at> econ.hit-u.ac.jp）

【授業の概要と目標】

「公共政策の実証分析」の準備段階として計量経済学の基礎的な分析手法を十分に習得すること。また、統計パッケージの基礎的な使用法の習得。

【教科書・参考書等】

- ・Stock, James H., Watson, Mark W., 2003. *Introduction to Econometrics*. Addison Wiley.
- ・松浦克己、コリン・マッケンジー. 2005. Eviews による計量経済学入門. 東洋経済新報社.

【成績評価の観点と方法】

定期試験と宿題による。

【授業の内容と進行】

教科書の項目に従って講義し、随時課題を課す。

回	日付	S-W	内容
1	4/12	1.1-1.3	イントロダクション やることとやらないこと／因果関係とは／データの種類
2	4/14	2.1-2.3	確率論(1) 確率変数と確率分布／期待値・平均・分散／2変数の場合
3	4/19	2.4-2.5	確率論(2) 代表的な分布／ランダムサンプリング／標本平均の分布
4	4/21	2.6	確率論(3) 大数の法則と一致性／中心極限定理
5	4/26	3.1-3.3	統計(1) 母平均の推定とその性質／信頼区間／仮説検定と p 値、t 値
6	4/28	3.4-3.6	統計(2) 標本平均の比較／標本共分散／相関係数
7	5/10	4.1-4.2	回帰分析の基礎(1) 線形回帰モデルとは／係数の推定／OLS 推定量
8	5/12	4.3-4.5	回帰分析の基礎(2) OLS 推定的前提／OLS 推定量の分布／係数推定値の仮説検定
9	5/17	4.6-4.10	回帰分析の基礎(3) 決定係数と標準誤差／分散均一・分散不均一
10	5/19	5.1-5.3	重回帰(1) 説明変数の見落とし／重回帰の基礎／OLS 推定量
11	5/24	5.4-5.7	重回帰(2) 重回帰的前提／OLS 推定量の分布／係数推定値の仮説検定
12	5/26	5.8-5.13	重回帰(3) 仮説検定／修正済み決定係数／モデルの特定化

13	5/31	6.1-6.2	非線形関数(1) 非線形なモデル化とその扱い／一変数の場合
14	6/2	6.3-6.5	非線形関数(2) 説明変数間の相関／交差項の扱い
15	6/7	7.1-7.2	回帰分析の評価(1) 内挿外挿／変数見落とし／特定化の誤り／サンプル選択
16	6/9	7.3-7.4	回帰分析の評価(2) 評価の例
17	6/14		中間試験
18	6/16	10.1-10.2	操作変数法(1) 操作変数法とは／外生変数と内生変数／操作変数法的前提
19	6/21	10.3-10.4	操作変数法(2) 適切な操作変数の確認／外生性の検定
20	6/23	10.5-10.6	操作変数法(3) 適切な操作変数の見つけ方／具体例
21	6/28	8.1-8.3	パネルデータ(1) パネルデータとは／固定効果モデル
22	6/30	8.4-8.6	パネルデータ(2) 時間効果モデル／二方向効果モデル／具体例
23	7/5	9.1-9.3	質的変数モデル(1) 2値変数とは／プロビット・ロジット／線形モデルとの比較
24	7/7	9.4-9.5	質的変数モデル(2) 推定方法／最尤法とは／モデルの評価
25	7/12	11.1-11.3	実験データ(1) 理想的な実験と因果関係／実際上の問題／DD 推定
26	7/14	11.4-11.5	実験データ(2) 実験のデザイン／自然実験・準実験
27	7/19	11.6-11.8	実験データ(3) 準実験の問題点／異質性と推定量の評価
28	7/21		予備日