

科目名 (Subject)	計量経済学 II <small>英訳</small> Econometrics II		
単位数 (Credits)	2 単位	開講時期	後期 Second Semester
担当教員名 (Name)	劉慶豊 <small>英訳</small> Qingfeng Liu	研究室番号 (Office)	525
Office Hours	随時。事前にメールで連絡してください。By email appointment only.		
<p><b>1. 授業目的・方法 (Course objective and method)</b>          経済問題の実証研究を行うための計量経済学の大学院レベルの基礎的な理論知識と標準的な手法を修得することを目的とする。講義は担当教員による授業を中心に進めるが、履修者に数回指定したテキストの内容に関して英語か日本語で報告してもらう。          This course is a graduate level introduction to basic econometric theory and methods that are useful for applied research in economics. The course will consist mainly of lectures by the instructor. Students will be required to give oral presentations about some of the following topics in English or Japanese.</p> <p><b>2. 授業内容 (Course contents)</b>          第1週：操作変数法          Instrumental Variable Estimation          第2~4週：分散不均一、系列相関          Heteroscedasticity, Serial Correlation          第5~6週：パネルデータ          Panel Data Analysis          第7~8週：同時方程式モデル          Simultaneous Equations Models          第9~11週：最尤法と一般化モーメント法          MLE and GMM          第12週：時系列モデル、定常確率過程          Time Series Models, Stationary Stochastic Processes          第13~14週：時系列モデル、非定常確率過程 I (単位根)          Unit Root          第15週：時系列モデル、非定常確率過程 II (共和分)          Cointegration</p> <p><b>3. 使用教材 (Teaching materials)</b>          William H. Greene, <i>Econometric Analysis</i>, 7<sup>th</sup> Edition, Prentice Hall, 2011.          Jeffrey M. Wooldridge, <i>Introductory Econometrics: A Modern Approach</i>, 3<sup>rd</sup> Edition, South-Western Pub, 2005.          A. Colin Cameron and Pravin K. Trivedi, <i>Microeconometrics: Methods and Applications</i>, Cambridge University Press, 2005.</p> <p><b>4. 成績評価の方法 (Grading)</b>          宿題の提出30%、報告の評価40%、期末試験30%。          The evaluation will be based on homework assignments (30%, in English or Japanese), oral presentations (40%, in English or Japanese) and a final exam (30%, in English or Japanese).</p> <p><b>5. 成績評価の基準 (Grading Criteria)</b>          経済学科コース統一基準 (シラバスの p. ) を参照のこと。          See <a href="#">this syllabus pp.</a></p> <p><b>6. 履修上の注意事項 (Remarks)</b>          十分に予習と復習をすること。計量経済学Iと同等以上の知識を持っていることは履修するための必要条件である。</p>			

