

科目名(Subject)	計量経済学Ⅱ (Econometrics II)		
単位数(Credits)	2単位	開講時期	後期
担当教員名 (Name)	劉慶豊 (Qingfeng Liu)	研究室番号 (Office)	525
Office Hours	随時。事前にqliu@res.otaru-uc.ac.jpへ連絡ください。		
<p>1. 授業目的・方法(Course objective and method) 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おう。 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>2. 達成目標(Course Goals) 計量経済学を用いた実証研究を行う能力を身につける。</p> <p>3. 授業内容(Course contents)</p> <p>第1週：操作変数法 Instrumental Variable Estimation</p> <p>第2~4週：分散不均一、系列相関 Heteroscedasticity, Serial Correlation</p> <p>第5~6週：パネルデータ Panel Data Analysis</p> <p>第7~8週：同時方程式モデル Simultaneous Equations Models</p> <p>第9~11週：最尤法と一般化モーメント法 MLE and GMM</p> <p>第12週：時系列モデル、定常確率過程 Time Series Models, Stationary Stochastic Processes</p> <p>第13~14週：時系列モデル、非定常確率過程Ⅰ(単位根) Unit Root</p> <p>第15週：時系列モデル、非定常確率過程Ⅱ(共和分) Cointegration</p> <p>4. 事前学修・事後学修(Preparation and review) テキストを用いて予習を行う。 学んだ知識を自分の研究課題への応用を試みる。</p> <p>5. 使用教材(Teaching materials) William H. Greene, <i>Econometric Analysis</i>, 7th Edition, Prentice Hall, 2011. Jeffrey M. Wooldridge, <i>Introductory Econometrics: A Modern Approach</i>, 3rd Edition, South-Western Pub, 2005. A. Colin Cameron and Pravin K. Trivedi, <i>Microeconometrics: Methods and Applications</i>, Cambridge University Press, 2005.</p>			

6. 成績評価の方法(Grading)

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).

7. 成績評価の基準(Grading Criteria)

秀(100~90):計量経済学について秀でた理解力を示し、計量経済学を応用して、さまざまな経済問題について秀でた分析をすることができる。

優(89~80):計量経済学について優れた理解力を示し、計量経済学を応用して、さまざまな経済問題について優れた分析をすることができる。

良(79~70):計量経済学について良い理解力を示し、計量経済学を応用して、さまざまな経済問題について良い分析をすることができる。

可(69~60):計量経済学について理解力を示し、計量経済学を応用して、さまざまな経済問題について分析をすることができる。

不可(59~0):計量経済学について十分な理解力を持たず、計量経済学を応用して、さまざまな経済問題について分析をすることができない。

8. 履修上の注意事項(Remarks)

授業の前後にテキストを利用して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。