

科目名(Subject)	計量経済学 I (Econometrics I)		
単位数(Credits)	2 単位	開講時期	前期
担当教員名 (Name)	寺坂 崇宏 (Takahiro Terasaka)	研究室番号 (Office)	430
Office Hours	随時 事前にメールで連絡をして日時を調整		
<p>1. 授業目的・方法(Course objective and method) 目的：計量経済学の古典的かつ標準的な手法を修得することを目的とする。「古典的かつ標準的な手法」だけでは、論文に出てくる計量経済分析を理解することは困難であるが、最新の計量経済的手法を修得するためには、これまで確立されてきた方法を熟知しなければならないので、この部分の習得を確実にしてもらうことを目的として授業を開講する。 方法：ゼミ形式（学生に教材の指定した箇所を予習して報告してもらい、その内容を教員と学生で検討する形式）で授業を進める予定である。必要に応じて、講義形式、実習形式を取り入れて授業を進める。</p> <p>2. 達成目標(Course Goals) 計量経済学の古典的かつ標準的な手法を修得することで、データを用いた計量経済的手法による論文を理解するための前提となる知識を得る。</p> <p>3. 授業内容(Course contents) 第1回 計量経済学とは何か？ 第2回～第3回 線形回帰モデル 第4回～第5回 最小2乗回帰 第6回～第8回 最小2乗法による回帰モデルの推定 第9回～第10回 仮説検定とモデル選択 第11回～第12回 関数形 差分の差分法 構造変化 第13回～第15回 非線形、セミパラメトリック、ノンパラメトリック回帰モデル、内生性と操作変数法</p> <p>4. 事前学修・事後学修(Preparation and review) 予習課題：指定された範囲の報告の準備をしてくる。準備の際、確実に理解すべき点について指示を出すので、その点を理解してから授業に来ること。 復習課題：授業中に指定された問題を解く。</p> <p>5. 使用教材(Teaching materials) William H. Greene (2020) <i>Econometric Analysis, 8th Edition (Global Edition)</i> を使用する。テキストのpart1 Linear Regression Modelのところを授業で取り扱う。授業内容は使用教材の各章に対応している。</p> <p>6. 成績評価の方法(Grading) 予習課題の達成度 25% 授業での報告の内容、授業への参加度 50% 復習課題の提出 25% 毎回の授業で上記の評価をする。欠席した場合は、その授業の評価は0となる。</p> <p>7. 成績評価の基準(Grading Criteria) 経済学コース 成績評価の統一基準を参照のこと。</p>			

8. 履修上の注意事項(Remarks)

経済学部3, 4年次レベルの計量経済学、統計学、経済数学のうち線形代数、微分法、積分法の知識、をすでに修得していることを前提に授業を進める。

計量経済学の大学院修士レベルの知識を修得したい場合は、「計量経済学Ⅰ」だけでなく、「計量経済学Ⅱ」も履修すること