

|                              |  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
|------------------------------|--|------|----|---------|----|------|------|-----|-----|-----------------|---------------------|------------------------------|----------------------------------|------------------------|-------------------------|---------------------|-----------------------|--------------------------|------------------------|------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|--|
| 講義コード                        | 11C0127400   | 授業形態 | 講義 | 事前登録の有無 | あり | 担当教員 | 王 在喆 | 開講期 | 第2期 |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 科目名                          | 実証経済分析2  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 履修前提条件                       |  |      |    |         | 備考 |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 授業の目的                        | <p>実証経済分析では、科学的に経済モデルを構築し、そのモデルによって経済社会の変化を的確に記述することができるかどうかを検証したうえで、現実社会経済変化の実態を明らかにすることを目指している。本講義では、実証経済分析についての基本的な分析手法をわかりやすく解説し、実証経済分析の実用性と楽しさを履修者に実感してもらう。</p> <p>授業では、まず、単純回帰分析の概要を紹介し、次に実証分析におけるよく使われる手法である回帰分析モデルを詳細に解説する。また、授業では経済統計データを用いて、Excelなどで演習を行うことも予定している。</p> <p>本講義は統計学と経済統計学を履修し、「実証経済分析1」も履修した学生の履修が望ましい。また、「計量経済学2」との同時履修を勧める。</p>   |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 到達目標                         | 経済社会の変化を実証分析するための重要性を認識し、必要不可欠な基本分析手法を習得することができる。  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 授業外学修内容・<br>授業外学修時間数         | この授業では指示された文献などの事前読了を求める。毎回の予習には120分かかると想定される。また、毎回の授業内容について、指示された文献を参考しながら各自で復習することも求められる。毎回の復習には90分かかると想定される。予習・復習と課題レポートの作成と合わせ、授業外に計90時間以上の学修を行うこと。  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 授業計画                         | <table border="0"> <tr> <td>【第1回】単純回帰モデルの概説</td> <td>【第9回】不均一分散2（各種検定方法）</td> </tr> <tr> <td>【第2回】重回帰モデル1（回帰モデルの古典的仮定と検定）</td> <td>【第10回】不均一分散3（解決方法：対数変換と実行可能なGLS）</td> </tr> <tr> <td>【第3回】重回帰モデル2（多重共線性の問題）</td> <td>【第11回】分布ラグモデル1（分布ラグモデル）</td> </tr> <tr> <td>【第4回】重回帰モデル3（ダミー変数）</td> <td>【第12回】分布ラグモデル2（多項式ラグ）</td> </tr> <tr> <td>【第5回】自己相関1（発生原因と推定量への影響）</td> <td>【第13回】分布ラグモデル3（コイックラグ）</td> </tr> <tr> <td>【第6回】自己相関2（検定方法）</td> <td>【第14回】分布ラグモデル4（適用的期待モデル）</td> </tr> <tr> <td>【第7回】自己相関3（解決方法：CO法とPW法）</td> <td>【第15回】分布ラグモデル5（部分調整ラグモデル）</td> </tr> <tr> <td>【第8回】不均一分散1（発生原因と推定量への影響）</td> <td></td> </tr> </table> |      |    |         |    |      |      |     |     | 【第1回】単純回帰モデルの概説 | 【第9回】不均一分散2（各種検定方法） | 【第2回】重回帰モデル1（回帰モデルの古典的仮定と検定） | 【第10回】不均一分散3（解決方法：対数変換と実行可能なGLS） | 【第3回】重回帰モデル2（多重共線性の問題） | 【第11回】分布ラグモデル1（分布ラグモデル） | 【第4回】重回帰モデル3（ダミー変数） | 【第12回】分布ラグモデル2（多項式ラグ） | 【第5回】自己相関1（発生原因と推定量への影響） | 【第13回】分布ラグモデル3（コイックラグ） | 【第6回】自己相関2（検定方法） | 【第14回】分布ラグモデル4（適用的期待モデル） | 【第7回】自己相関3（解決方法：CO法とPW法） | 【第15回】分布ラグモデル5（部分調整ラグモデル） | 【第8回】不均一分散1（発生原因と推定量への影響） |  |
| 【第1回】単純回帰モデルの概説              | 【第9回】不均一分散2（各種検定方法）  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第2回】重回帰モデル1（回帰モデルの古典的仮定と検定） | 【第10回】不均一分散3（解決方法：対数変換と実行可能なGLS）   |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第3回】重回帰モデル2（多重共線性の問題）       | 【第11回】分布ラグモデル1（分布ラグモデル）  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第4回】重回帰モデル3（ダミー変数）          | 【第12回】分布ラグモデル2（多項式ラグ）  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第5回】自己相関1（発生原因と推定量への影響）     | 【第13回】分布ラグモデル3（コイックラグ）   |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第6回】自己相関2（検定方法）             | 【第14回】分布ラグモデル4（適用的期待モデル）   |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第7回】自己相関3（解決方法：CO法とPW法）     | 【第15回】分布ラグモデル5（部分調整ラグモデル）  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 【第8回】不均一分散1（発生原因と推定量への影響）    |  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 成績評価の方法                      | <p>授業への取り込み：20%</p> <p>課題レポート（2回）：40%</p> <p>期末レポート：40%</p>  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| フィードバックの内容                   | 課題レポートについては授業内で解説し、また個別指導を行う。  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 教科書                          |  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 指定図書                         |  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 参考書                          | 『計量経済学』井出真弘（産能大学出版部）平成13年、『計量経済学』蓑谷（多賀出版）1998、『実証分析入門』森田果（日本評論社）2014   |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| 教員からのお知らせ                    | 教科書は第一回授業の時に指示する。  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| オフィスアワー                      | 水曜日18：00－19：30。2号館511研究室。  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |
| その他                          |  |      |    |         |    |      |      |     |     |                 |                     |                              |                                  |                        |                         |                     |                       |                          |                        |                  |                          |                          |                           |                           |  |