

科目名	指定	期間	単位	年次	氏名
計量経済学	選	後	4	3	河田 正樹

### 【テーマ】

計量経済学入門

### 【目的と概要】

計量経済学とは、さまざまな経済理論にもとづき数式の形で表された経済モデルを、データを用いて、統計的手法によって検証するものである。

社会科学である経済学において、経済モデルが意味を持つためには、そのモデルが理論整合的であるかどうかだけでなく、現実の経済に適合しているかを検証する必要がある。その検証を行うのが、データを用いた、統計的手法による分析である。

この講義では、経済データを分析するための統計的手法と問題点の解決方法について学ぶことを目的としている。

### 【講義内容】

計量経済学はその理論を学ぶことが重要であるとともに、実際に経済データを用いて分析ができるようになることも重要である。

この講義では計量経済学の理論的な講義を中心とし、理論の理解を助けるために表計算ソフト Excel や計量経済学ソフト TSP を用いたコンピュータ実習をおこなう。

具体的な講義内容としては次のようなものを考えている。

1. 統計学の復習
2. 単回帰モデル
3. 重回帰モデル
4. 回帰分析の諸問題(1)
  - (a) 多重共線性
  - (b) 系列相関
  - (c) 不均一分散
5. 回帰分析の諸問題(2)
  - (a) 分布ラグ
  - (b) ダミー変数
6. 連立方程式モデル
7. 時系列モデル

最初に、計量経済学を学ぶ上で必要となる、統計学についての復習を行う。

次に、計量経済学において中心的な役割を果たす回帰分析の手法について学び、経済データを分析する際に問題となる系列相関、不均一分散、多重共線性などの問題に関して、その原因と対処法を学ぶ。

最後に、時間が許せば、連立方程式モデルや時系列モデルといったマクロ経済分析に有効な方法についても学ぶ。

### 【受講上の留意点】

この講義は、「統計学」および「経済データ解析」が履修済みであることを前提としておこないます。前年度までに未修の人は今年度履修するか、同等の内容を自習することによって補ってください。

講義に関する情報は、講義用 HP(<http://www2.tokuyama-u.ac.jp/kawada>)に順次掲載していきますので、こちらも参照してください。

### 【ひと言】

計量経済学はきちんと理解することは容易なことではありません。私のほうもなるべくわかりやすい講義をおこなうつもりですが、ただ授業に出席しているだけで理解することは不可能でしょう。毎回きちんと授業に出席し、練習問題をきちんとこなすなどの復習をきちんと行う**意欲のある学生のみ履修する**ようにしてください。

### 【使用テキスト】

水野 勝之『テキスト計量経済学 (第2版)』中央経済社 3,360 円

<参考書>

宮川 公男『基本統計学 (第3版)』有斐閣 2,835 円

佐竹 元一郎・野口 和也『統計理論入門』中央経済社 3,059 円

S.チャタジー・B.プライス(佐和 隆光・加納 悟 訳)『回帰分析の実際』新曜社 2,625 円