

「計量経済学特論（応用計量経済学）」講義計画

2006 年度冬学期 火曜日 10:35～12:05 205 号室

川口大司 磯研 401 号室 (kawaguch@econ.hit-u.ac.jp)

1. 講義計画

応用を主眼に置きつつ、マイクロデータを扱うための計量経済学、すなわちマイクロエコノメトリクスを教科書に沿って講義する。適宜、応用例として労働経済学、公共経済学、産業組織論といった分野の実証分析を紹介する。

2. 履修の条件

大学院1年次のエコノメトリクスのコースワーク(2クラス)を終えていることを履修の条件とする。

3. 教科書

Jeffrey M. Wooldridge, *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, The MIT press, 2001

Jeffrey M. Wooldridge, *Introductory Econometrics 3rd Edition*, South Western College Publishing, 2006

4. 成績評価

数度の宿題(50%)、学期末の試験(50%)によって、成績をつける。

5. オフィスアワー

月曜日 4時20分～5時50分 それ以外はE-mailであらかじめ予約すること。

6. 講義内容

以下の項目を講義する予定である。予定は変更されることがありうるが、その都度クラスで連絡する。15回の講義を予定している。

準備

－条件付き期待値・漸近理論の復習 Wooldridge (2001) Chap. 2 – 3. (1回)

クロスセクションデータの分析

－OLS の復習 (応用を念頭に引き、Omitted Variable Bias や Measurement Error を重点的に学習する) Wooldridge (2001) Chap. 4 (2回)

－OLS を応用で利用する際の諸問題の考察 Wooldridge (1999) Chap. 6 – Chap. 9 (2回)

－Instrumental Variable 推定の復習 (1回)

－Instrumental Variable を用いた最近の実証研究の紹介 (1回)

－単一方程式モデルに関連する諸問題の考察 Wooldridge (2001) Chap. 6 しかし、Wooldridge (1999) Chap. 6 – Chap. 9 でカバーされた範囲はとばす。 (2回)

パネルデータの分析

－パネルデータを分析するための推定法 Wooldridge (2001) Chap. 10 (2回)

－応用上の諸問題 Wooldridge (2001) Chap. 11 (10/30, 11/6, 11/13) (2回)

パネルデータの分析に関しては Wooldridge (2006) Chap. 13, Chap. 14 も入門的な取り扱いをしている。

非線型モデル (2回)

－被説明変数が離散変数の場合の推定法 (プロビット・ロジットなど) Wooldridge (2001) Chap. 15 (11/20, 11/27)

－被説明変数が端点解、あるいは切断されている場合の推定法(トービットなど) Wooldridge (2001) Chap. 16 (12/4, 12/11)

－サンプルセレクション・パネル磨耗 (Panel Attrition) ・層化抽出標本 (Stratified Sample) の分析 Wooldridge (2001) Chap. 17 (12/18, 1/8) (1回)