

「上級計量経済学Ⅱ」講義計画

2007年度夏学期 火曜日 3時限 (12:55-14:25) 205号室

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

1. 講義計画

クロスセクションデータとパネルデータを取り扱うための計量経済学を講義する。非線形モデルの推定と推論に関して M 推定量の枠組みの中で一般的な議論をしたのちに、Probit, Logit, Tobit, Heckit といったパラメトリックモデルを取り上げる。時間が許せば、処置効果モデルの推定やノンパラメトリックモデルの推定についても議論する。労働経済学・開発経済学・公共経済学・産業組織論といった応用ミクロの実証分野での応用に主眼を置く。

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時限 (14:40-16:10) 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。

M-Estimation

Maximum Likelihood Methods

Generalized Method of Moments and Minimum Distance Estimation

Discrete Response Models

Corner Solution Outcomes and Censored Regression Models

Sample Selection, Attrition, and Stratified Sampling

Count Data and Related Models

Duration Analysis