

計量経済学 FH22 021 / K62 1201

第1 学期 木曜 1,2 時限 (2 単位)

対象：2～4 年生

担当教員：浅野 哲

研究室：3F1232

E-mail：asano@sk.tsukuba.ac.jp

Office hour:水 10:30-12:00

教科書：浅野哲・中村二郎「計量経済学」有斐閣 2000

参考書：山本拓 「計量経済学」新世社 1995

授業概要・教育目標：計量経済学はデータから経済理論を検証する手法である。この授業ではミクロ経済学、マクロ経済学、初等統計学と線形代数の初歩的な知識を前提として、古典的回帰モデルの理論と応用例の解説を中心に講義する。

授業計画

第1 週	計量経済学とは何か、応用例
第2 週	統計学、線形代数の基礎（期待値、分散、共分散、ベクトル、行列、行列式等）
第3 週	2 変数回帰モデル、2 変数回帰モデルにおける最小二乗法、決定係数
第4 週	関数形の選択、推定量の統計的性質、仮説検定
第5 週	Z 検定、t 検定、ガウス・マルコフ定理
第6 週	中間テスト、回帰の錯誤
第7 週	K 変数回帰モデル、推定値の統計的性質
第8 週	K 変数回帰モデルの応用例 1
第9 週	K 変数回帰モデルの応用例 2、多重共線性
第10 週	想定外の誤り、一般化古典的回帰モデル

成績評価：中間試験と期末試験の結果による。

備考：前提科目：統計学、ミクロ経済学、マクロ経済学