

マクロ計量分析 FH22 031 / K62 1301	
第 2 学期 月 曜 5・6 時限 (2 単位)	対象： 2-4 年生
担当教員： 大久保正勝 3F1106 電話 853-5369 E-mail： okubo@sk.tsukuba.ac.jp Office hour: 授業で連絡する。	
教科書： 初回の授業で指示する。 参考書： Stock, J.H. and M.W. Watson (2006) Introduction to Econometrics, 2 nd ed., Addison-Wesley Enders, W. (2003) Applied Econometric Time Series 2 nd ed., Wiley	
授業概要・教育目標： 時系列データを用いた経済理論モデルの統計的な検証方法とその応用例を解説する。	

授業計画：	
第 1 週	導入：経済モデルと非定常時系列分析，仮説検定の基礎概念
第 2 週	定常性と自己回帰モデル
第 3 週	単位根とランダムウォークモデル
第 4 週	単位根検定
第 5 週	共和分と共和分検定
第 6 週	共和分回帰と誤差修正モデル (1)
第 7 週	共和分回帰と誤差修正モデル (2)
第 8 週	Granger 因果関係
第 9 週	インパルス応答関数
第 10 週	予測分散分解

成績評価： 課題と期末試験により評価する。
備考：微積分、線形代数、統計学、計量経済学、マクロ経済学、ミクロ経済学を既に履修済みで、それらの基礎概念を十分理解していることを前提とする。学内で利用可能な TSP, Eviews, STATA, MATLAB などのソフトウェアを用いて、既に計量分析を行った経験があることが望ましい。