

グローバルシステムエリア演習 FH21 012/K61 1102	
第1学期 金曜 5-6時限 (2単位)	対象：3-4年生 (社会工学類の3-4年生を優先する)
担当教員：藤井 英次 3F1237 電話 853-5176 E-mail: efujii@sk.tsukuba.ac.jp Office hours: 授業にて公表	
教科書：教科書は用いない。	
授業概要・教育目標： 現実の経済動向を実証的に評価するには経済理論に基づくモデルの定式化、データの収集・加工、適切な統計的手法の選択、プログラムの作成、推定結果の評価・解釈といった多くのステップを踏まなければならない。本演習では外国為替レート、金利、物価などの動きを題材として選び、実証分析の基本的な手法を学ぶ。	

授業計画：	
第1週	ガイダンス、序論：経済変数としての外国為替レートについて
第2週	外国為替レートと経済の基礎的条件
第3週	外国為替レートの構造モデルとその評価
第4週	最小二乗法による回帰分析・仮説検定の復習、「TSPを使う-1」
第5週	国際経済データの収集・加工、「TSPを使う-2」
第6週	時系列データの定常性・非定常性、「TSPを使う-3」
第7週	モデル推定と為替予測、「TSPを使う-4」
第8週	プロジェクト実習 (TSPを用いた推計・分析)
第9週	プロジェクト実習 (TSPを用いた推計・分析)
第10週	プロジェクトの報告会

成績評価：出席、授業における課題、プロジェクトレポート、プレゼンテーションによる総合評価。
備考：統計学の理解を前提とするため、受講者を統計I・IIを履修済みの学生に限る。また、国際金融論及び計量経済学を事前或いは同時に履修することを強く推奨する。演習科目の性質上、履修希望者が多数の場合は人数制限を設けることがある。