

科目名	計量経済学B Econometrics B						
科目担当者	墨 昌芳 SUMI Masayoshi						
単位数	2	配当年次	2年	授業形態	講義	開講学期	後期
履修学部・学科 [区分]	経営学部・経営学科 [専門教育科目 専門科目]					ディプロマポリシーとの関連	(3)(4)
授業の概要	本講義は、始めに回帰分析に関する内容を復習します。その後、計量経済学Aで学んだ内容を発展させ、不均一分散の問題や系列相関、及び、操作変数法やロジット・プロビット、パネル分析などさまざまな分析方法を紹介します。その中でも特に内生性を排除するためのパネル分析の考え方と意義について説明します。受講生には、興味・関心のあるテーマについて、学んだ計量経済学的手法（パネル分析）を実際に活用してもらう機会としてグループ発表を行ってまいります。						
授業の到達目標	①正しくデータ分析（パネル分析など）を行うことが出来る。 ②計量モデルにおける内生性の解決策を提示することが出来る。						
授業計画・内容	1	ガイダンス：今後の講義概要、計量経済学Aの復習					
	2	回帰分析の復習、及び、課題演習					
	3	回帰分析と各種検定（t検定、F検定、Chow検定）					
	4	不均一分散の問題					
	5	系列相関					
	6	系列相関の検定					
	7	操作変数法					
	8	線形同時方程式モデル					
	9	最尤法とは					
	10	線形同時方程式モデル					
	11	ロジット・プロビットモデル					
	12	パネルデータ分析（1）：考え方					
	13	パネルデータ分析（2）：課題演習					
	14	プレゼンテーション（1）：第1グループによる発表					
	15	プレゼンテーション（2）：第2グループによる発表					
授業外学修 (事前学修)	発表のための準備を行う（15時間程度）						
授業外学修 (事後学修)	授業内容について分からない点などを復習し、不明点を調べておく（毎週2時間程度、合計30時間） 課題を作成する（15時間程度）						
成績評価方法・ 評価比率・到達 目標との対応	成績評価方法					評価比率	到達目標との対応
	定期試験					50%	①、②
	課題の提出 プレゼンテーション					30% 20%	①、② ①、②
成績評価基準	秀：（評点90点以上）到達目標を極めて高い水準で達成している場合 優：（評点80点～89点）到達目標を高い水準で達成している場合 良：（評点70点～79点）到達目標を一定の水準で達成している場合 可：（評点60点～69点）到達目標を最低限の水準で達成している場合 不可：（評点60点未満）到達目標に達していない場合						
教科書	教科書は特に使用しない。教材を必要に応じて（ほぼ毎週）配布する。						
参考文献	Wooldridge, J. M. <i>Introductory Econometrics: A Modern Approach 5th Edition</i> , Cambridge: MIT Press. 山本 拓『計量経済学』新世社						
その他	本講義を履修するにあたっては統計学Ⅰ・Ⅱ、計量経済学Aを既に履修していることが望ましいのですが、未履修者もフォローできるように、当初はこれからの科目の復習を徹底的に行う予定です。 <どのような学生の受講が望ましいのか> 統計データを使った調査・研究に興味がある学生 卒業論文に統計分析の使用を考えている学生 <あらかじめ受講して欲しい科目> 統計学Ⅰ・Ⅱ、計量経済学A						