

経済データ分析 S1 ターム 2018

大森裕浩

研究室: 経済学研究科棟 1301 (13F)

Email: omori@e.u-tokyo.ac.jp

Web page: <http://www.omori.e.u-tokyo.ac.jp/>

講義: 13:00-14:45 (月・木)

講義概要:

データを用いて経済分析を行うためには、手計算が可能なごく単純な方法を例外としてコンピュータ・ソフトウェアによる計算が必要となります。この講義では、教育用計算機センターの使い方、データベースの利用のしかたから始めて、現在広く使われている計量経済分析ソフトウェアの **Stata** を例にとり、さまざまな経済分析の方法を紹介し、同時に計算結果の解釈について説明します。本講義の目的は、コンピュータ・アウトプットから、計量経済モデルの意味を正しく理解し、経済分析を行う能力を養うことにあります。また計量経済分析ソフトウェアとして **Stata** を用いていますが、アウトプットの内容は他のソフトウェアについても概ね同様です。

成績: 期末試験 100% (自筆ノートのみ持込可を予定)

教材等

- (1) 教科書: 『コアテキスト 計量経済学』大森裕浩. 新世社 2017年 ただしプリントを中心に講義を行う。
- (2) 使用するソフトウェア: Stata 15
- (3) 参考文献
 - ① Hamilton, L.C. (2013) Statistics with Stata: Version 13, 8th edition Brooks/Cole <http://www.stata.com/bookstore/sws.html>
 - ② Christopher ,F. B.(2006) An Introduction to Modern Econometric Using Stata. Stata Corp. <http://www.stata.com/bookstore/imeus.html>
 - ③ 『Stataによるデータ分析入門』第2版 松浦寿幸. 東京図書 2015年

講義内容

1. 教育用センターのシステムの使い方

日経 NEEDS の使い方, Stata の基本

2. 回帰分析 (単回帰)
基本統計量, 最小二乗法, 単回帰分析, 仮説検定
3. 回帰分析 (重回帰)
重回帰分析, 仮説検定, 線形制約の仮説検定 (生産関数の一次同時性・構造変化・グレンジャー因果性)
4. 回帰の診断
多重共線性, 残差分析 (不均一分散・系列相関), 系列相関の仮説検定とその修正
5. パネルデータの分析
パネルデータの要約, 平均値を用いた回帰, 固定効果モデル, 変量効果モデル
6. 選択行動のモデル
ロジット・プロビットモデル, 順序ロジット・プロビットモデル, 多項ロジット・プロビットモデル
7. 様々な計量経済分析の手法
トービットモデル, サンプルセレクションモデル
(計数データのモデル, 生存時間分析, 時系列モデル分析ほか)