

2017年度学術交流支援資金 外国語電子教材作成 報告書

総合政策学部 准教授 和田龍磨

科目名： Econometrics (GIGA)/計量経済学

概要

GIGA 科目として開講されている **Econometrics** では、授業が英語で行われ、教科書には米国の標準的なマクロ経済学のテキストである **Jeffrey Wooldridge “Introductory Econometrics”** が使用されている。本教材はこのテキストの副教材（スタディーガイド）として使用されることを念頭に置いている。この教科書の問題点をいくつか挙げるとすると、前提となる統計学については巻末の付録に載っているものの、どのあたりまで学んでから本章に入るべきか、わかりにくいことと、計量手法を扱っている各章がどのように関連しているかが分かりにくいことである。もう一つの標準的なテキストである **James Stock and Mark Watson, “Introduction to Econometrics”** ではこの辺りは比較的明瞭であるが、例が日本で学ぶ学生には親しみの少ないもの（例えば公立学校の質がその地域の資産価値に依存するなど）となっており、必ずしもわかりやすいとは言えない。この点を踏まえて、本教材を作成した。2つの教科書の良いところを取り入れつつ、必要に応じ解説（式展開など）を取り入れた。

さらに、付録として、高度ではあるが計量経済学の応用である時系列分析においてしばしば使われる、カルマンフィルターについての講義ノートも作成した。

来年度以降、**International Finance** を履修する学生はあらかじめこの教材をダウンロードしておくことにより、予習復習を自分自身のペースで行うことが可能になる。

さらに、この科目を履修すべきかを決める際にもこの教材が役立つだけでなく、独学で計量経済学を学びたいという人の要求にもある程度こたえられるものになっている。

教材 URL

<http://econ.sfc.keio.ac.jp/Econometrics.pdf>

<http://econ.sfc.keio.ac.jp/Kalman1.pdf>

<http://econ.sfc.keio.ac.jp/Kalman2.pdf>

内容

1. Introduction
2. Review of Probabilities and Statistics
3. Review of Statistics
4. The Simple Regression Model
5. Multiple Regression Analysis: Estimation
6. Multiple Regression Analysis: Inference
7. Multiple Regression Analysis: Further Issues

付録

Kalman Filter 1

Kalman Filter 2

今後の課題

来年度秋学期の **Econometrics** の授業において使用するが、授業に合わせて不足点、改良点などが見当たると思うので、適宜改訂版を作成し URL に掲載する予定である。特に、当初盛り込む予定であった練習問題とその解法については若干の問題しか載せることができなかった。この点は今後整備し、内容を豊富にしてゆく。

昨年度本基金の補助を受けて作成された電子教材 **International Finance** については、本年度より履修者は学期の初めにすべて講義内容がダウンロード可能となった。一昨年に作成された **Macroeconomics 2** とその録画された講義については今後編集を経て電子教材の一部に組み込む予定であるが、本教材についても来年度以降に講義のビデオ撮影を行い、これもあわせて掲載することを検討している。