

1. 授業の目的と概要

動学的一般均衡マクロモデルの実証分析の手法学習およびコンピュータ実習を行う。

2. 学習の到達目標

動学的一般均衡マクロモデルの構築、線形近似、データ構築、パラメータの推定、シミュレーション等の方法を習得する。

3. 授業の内容・方法と進度予定

下記の教科書を用いてマクロモデルの実証分析手法を一通り学習する。授業は参加者による報告とコンピュータによる実習を適宜組み合わせる予定である。内容は以下の通り。なお、後半のトピックは演習 Ib で取り扱う。

1. 動学的一般均衡 (DSGE) モデルの線形近似
2. トrend除去
3. 統計量の抽出
4. DSGE モデルの 3 つの例
5. カリブレーション
6. モーメント法
7. 最尤法
8. ベイズ法
9. DSGE モデルの非線形近似
10. 非線形モデルの推定

4. 成績評価方法

報告および平常の参加状況による

5. 教科書と参考書

Dejong and Dave (2007) Structural Macroeconometrics, Princeton University Press

6. 予習と復習について

報告担当者は十分な準備が求められます。

7. その他（使用言語、履修の条件、連絡先、オフィスアワー等）

本授業は理論経済学 II 演習と連続で行うので併せて履修すること。授業では GAUSS というプログラム言語を用いてシミュレーションおよび推定を行う。授業中にもチュートリアルを行うが、あらかじめコンピュータの操作に慣れておくことが望ましい。

