

構造的マクロ計量経済学

大垣昌夫
オハイオ州立大学教授

概要

このセミナー・シリーズでは、マクロ経済モデルから計量経済学モデルの中への写像を研究する構造的マクロ経済学において、いろいろなマクロ経済モデルをいかにして計量経済学モデルと関連づけるかについて取り上げる。研究者は、構造的マクロ計量経済学の知識を用いて、マクロ経済モデルのパラメータを推定し、また、マクロ経済モデルを検定することができる。このセミナー・シリーズのトピックは、線形合理的期待モデルの推定と検定、定常確率過程と非定常確率過程、自己回帰の単位根、共和分、ベクトル自己回帰、ジェネライズド・メソッド・オブ・モーメンツ、エラー・コレクション・モデルなどを含む。

テキストは Masao Ogaki, Kyungho Jang, and Hyoung-Seok Lim (2004), *Structural Macroeconometrics*, manuscript in progress. を用いる。このテキストは <http://economics.sbs.ohio-state.edu/ogaki/index.html> において、Econ 894 をクリックし、さらに Lecutre Note をクリックすると入手できる。

セミナー計画

章は Ogaki, Kim, and Lim (2004) より。

第一回： 線形モデルにおけるストキャスティック・リグレッサーズ (第1章)、ロング・ラン・コヴァリアンス・マトリックスの推計 (第6章)、線形予測モデルの検定 (第7章)

第2回： ベクトル回帰のテクニック (第8章)、ジェネライズド・メソッド・オブ・モーメンツ (第9章)

第3回： ジェネライズド・メソッド・オブ・モーメンツを用いた実証分析 (第10章)、単位根非定常確率過程 (第11章)

第4回： 共和分とスプリアス回帰 (第12章)、経済モデルと共和分 (第13章)

第5回： 線形合理的期待モデルの推定と検定 (第14章)、ベクトル自己回帰と単位根非定常確率過程 (第15章)、パネルとクロス・セクショナル・データ (第16章)