

2004 年度一橋大学経済研究所

パネルデータの実証分析

シラバス

講師：筑波大学人文社会科学研究所

川口大司(kawaguch@sk.tsukuba.ac.jp)

時限：金曜日 12:55-16:10

場所：経済研究所4階会議室

1. 目的：

この講義では教科書に基づきパネルデータの実証分析の手法について理論と応用の両側面から解説する。

2. 履修要件：

大学院1年目の計量経済学のコースワークの知識を前提とする。

3. コースの概要：

4月16日 OLS, IV の復習、線形パネルモデル

4月30日 線形パネルモデル

5月14日 非線形パネルモデル

5月21日 予備日

4. 教科書ならびに参考書：

Required:

Jeffery M. Wooldridge (2001) *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, MIT press.

Recommended:

Cheng Hsiao (1986) *Analysis of Panel Data*, Cambridge University Press.

Badi H. Baltagi (1995) *Econometric Analysis of Panel Data*, Wiley.

Manuel Arellano (2003) *Panel Data Econometrics*, Oxford University Press.

Manuel Arellano and Bo Honore (2001) "Panel Data Models: Some Recent Developments,"

in

*Handbook of Econometrics Vol. 5*, North-Holland.