

FAQ Self-Study Guide

以下、経済学周辺学部の大学院生がその所属する大学院に適切な実習コースがない場合に一人またはグループで取り組みばよいと思われる書物とリンクをあげておく。計量経済学やその周辺の学問体系は、マルクス経済学に由来する学び方の「輪読」や「レジメ」学習法からは何も得るものはないので注意してほしい。自分の手で実際に動かしてその仕組みを知る他はない。おそらく、2～3人でそれぞれのコンピュータに並んで1つ1つパッケージを動かしていくのが適当だろう。下記のもはそのほとんどが「パッケージ計算の方法」を扱っている。プログラムを学ぶには、また本書に戻ってきてほしい。

初級

Wooldridge J., “Introductory Econometrics: A Modern Approach” South-Western College Publishing, 2000 ISBN: 0324113641

Stata Code <http://fmwww.bc.edu/gstat/examples/wooldridge/wooldridge.html>

Shazam コード&データセット <http://shazam.econ.ubc.ca/student/wooldridge/>

Berndt E. “The Practice of Econometrics” Addison Wesley, 1991, ISBN 0-201-51489-3

全 TSP コード&データセット <http://www.stanford.edu/~clint/berndt/>

Shazam コード&データセット <http://shazam.econ.ubc.ca/student/berndt/>

中級

Griffiths W.& Hill C., “Learning and Practicing Econometrics” John Wiley & Sons, January 1993, ISBN 0471513644

完全準拠 SAS コードマニュアル

Griffiths W., Hill C. & Judge G., “Learning and Practicing Econometrics, SAS Handbook” John Wiley & Sons, Book and Disk edition, June 1993, ISBN 047158553X

(なお上記のコードマニュアルには Shazam 版(5 インチ Disk) “Learning and Practicing Econometrics, Shazam Handbook” もあるが、現在は中古新古市場で出まわっている。スタイルは全く同じ。農業経済系の人には必読。)

Online RunShazam & データセット <http://shazam.econ.ubc.ca/student/ghj/>

上級

Greene W., “Econometric Analysis” Fourth Edition, Prentice-Hall, 2000

SAS コード他 <http://www.ats.ucla.edu/stat/stata/examples/greene/default.htm>

Shazam コード&データセット <http://shazam.econ.ubc.ca/student/greene/>

時系列

Tsay R., “Analysis of Financial Time Series” Wiley, 2002. ISBN 0-471-41544-8

(プログラムは本文中に RATS や SCA、S などのコードが記述されている)

データ <http://gsbwww.uchicago.edu/fac/ruey.tsay/teaching/fts/>

ブロックウエル、デービス『入門時系列解析と予測』CAP 出版 2000, ISBN:4916092287

(プログラムはCD-ROMとして付属、英文書籍よりも日本語版は新しく廉価)

パネルデータ

Wooldridge J. “Econometric Analysis of Cross Sections and Panel Data” 2001, MIT Press, ISBN: 0262232197

RATS コード http://www.estima.com/procs_wooldridge.shtml

カウントデータ

Cameron A.C.& Trivedi T. “Regression Analysis of Count Data” Cambridge Univ Press, 1998, ISBN: 0521635675(Paper)

公式コード <http://www.econ.ucdavis.edu/faculty/cameron/racd/racddata.html>

サバイバル分析

Hosmer D. & Lemeshow S., “Applied Survival Analysis: Regression Modeling of Time to Event Data” Wiley-Interscience, 1999, ISBN: 0471154105

Stata/R/SAS コード <http://www.ats.ucla.edu/stat/examples/asa/>

その他、統計の原論については上と平行して XLISP-STAT または R またはその両方を学んでいく方法が望ましいと考える。詳しくはコンバージョンの節をみてほしい。アドバイスをするならば、例えば、時系列を学ぶのに分厚い Hamilton を購入してコピー用紙を平らにするための重石にはしてはいけない。また、国内の数理統計系の学者の書物を読んで、通常の計量経済学の教科書との接点の極めて希薄な数理的な隘路に迷い込んではいけない。なお繰り返しになるが、GAUSS に関しては、次の 2 つがある。注意点は本書の対応ページを参照してほしい。学習の順番は上記のパッケージソフトの学習はそのままの順序、そして下記の GAUSS に関しては、上記を Greene まで到達してから、時系列やサバイバルに行く前に、次のものをその順番で進めるのが望ましい。

上級プログラム (GAUSS)

Lin K-P., “Computational Econometrics: GAUSS Programming for Econometricians and Financial Analysts(with CD-ROM)” ETEXT , 2001 ISBN: 0970531435

ただし、バージョン 4 以上使用場合、<http://eclab.econ.pdx.edu/gpe2/gpeorder.htm> からソフトだけを購入のこと。(付属旧バージョン 3.6 は他のバージョンとも共存可能)

超上級

Mittelhammer R., Judge G. & Miller D., “Econometric Foundations Pack with CD-ROM” Cambridge University Press, 2000 ISBN: 0521623944

例題ガイド <http://www.econometricfoundations.com/GeneralRes/ExpGuides.html>