

2010 年度後期「金融経済論I」(担当:塩路)講義要綱

講義のホームページ：<http://www.econ.hit-u.ac.jp/~shioji/kinkei2010.htm>

(3 年前の講義のホームページが<http://www.econ.hit-u.ac.jp/~shioji/kinkei.htm>に残されており、かなり参考になるはず)

教科書：加藤涼『現代マクロ経済学講義：動学的一般均衡モデル入門』東洋経済→主にその前半を用いる。

成績評価の方法：Matlab 実習課題(数回)と期末試験(理論面を中心)による。

講義の目的：確率的動学一般均衡(Dynamic Stochastic General Equilibrium)モデルについて、その背後にある考え方を理解した上で、最も基本的な解法をパソコンにより実践できるようになること。

講義の特徴：行列演算などを行うソフトウェアであるMatlabを講義を通じて使う。学生版http://www.mathworks.com/academia/student_version/は 1 万円くらいと聞いているので、これを買えば家でも宿題ができる。冬休み中も……。しかも情報基盤センターの「統計アプリケーション室」のパソコンにはない機能がついている(特にSymbolic math toolbox)。

困っていること：何回か情報基盤センターでパソコン実習をやるつもりでいたら、1 時限目は講義では使えないそうである。さてどうしたものか。

講義プラン

0 動学的モデル入門

0-1 差分方程式(1 変数)

0-2 差分方程式(2 変数以上)(教科書第 1 章補論 1,3)

0-3 動学的最適化入門 (教科書 7.2 節)

0-4 Matlab 基礎の基礎

1 動学的一般均衡モデル

1-1 New IS-LM モデル：概要と解法

1-2 New IS-LM モデル：Matlab による実践

1-3 RBC モデル：概要と解法

1-4 RBC モデル：Matlab による実践

2 財市場の不完全性

3 フリーソフトDynareの使い方(<http://www.dynare.org/>)

4 Dynare の実用例(小国開放経済モデルなど)