

## 2011 年度夏学期「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/>からアクセス可能

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。宿題が 40%、期末試験が 60%。

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/](http://www.mathworks.com/academia/student_version/)は 1~2 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。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)。

TA は現在申請中。認められれば、統計アプリケーション室でオフィスアワーを開いてもらうつもりなのだが、さて。

### 講義プラン

#### 第 I 部

- I-1 動学的モデル入門：線形差分方程式(1 変数の場合)
- I-2 Matlab 基礎の基礎
- I-3 Matlab による動学モデルの解法 (1 変数の場合)
- I-4 線形差分方程式 (2 変数以上の場合)：図による解法
- I-5 線形差分方程式 (2 変数以上の場合)：式による解法
- I-6 Matlab による動学モデルの解法 (2 変数以上の場合)

#### 第 II 部

- II-1 動学的最適化入門 (教科書 7.2 節)
- II-2 モデルの線形近似・対数線形近似について
- II-3 実物的景気循環モデル (教科書第 1 章)
- II-4 ニューケインジアン・モデル (教科書第 2 章)

## 第 III 部

- III-1 フリーソフト Dynare の使い方
- III-2 実物的景気循環モデル：Dynare による解法
- III-3 小国開放経済 RBC モデル
- III-4 労働市場におけるサーチとマクロモデル
- III-5 資本市場の不完全性とマクロ経済学(Kiyotaki-Moore (1997)モデル)