

経済統計

経済統計部門は大別して統計学、計量経済学、計量ファイナンスの3分野から構成されている。計量ファイナンスは、2004年度から発足した5年一貫教育システムの一分野である「統計・ファイナンスプログラム」に関連して開講科目の大幅な拡充を行った結果、本部門の主要な分野の一つとなったもので、これまで金融工学教育センター(Center for Financial Engineering Education: cfec)を核として優秀な修士修了生を金融工学の現場に輩出してきた。いずれの分野も、経済現象など様々な現象に関する統計データを分析する手法の教育・研究に携わるものである。本部門の教育体系の特徴は、学部から大学院までの一貫した積み上げ方式にある。以下では、各分野毎に教育科目・研究について概説する。

統計学に関連する主要な講義科目としては、学部新生を対象とした100番台必修科目の「統計学入門」、200番台科目の「確率・統計」、300番台科目の「統計学」そして「経済統計論 A・B」、400番台科目の「上級統計学」、「確率論」、「確率・統計特論」、500番台科目の「上級統計学」、「確率論」がある。研究面では、主として統計学や数理ファイナンス分野で時系列解析、逐次解析、生存時間解析、ノンパラメトリック、ウェーブレット、金融確率解析等が主たる研究対象となっている。

計量経済学関連の主要な講義科目としては、200番台選択必修科目の「基礎計量経済学」、300番台科目の「数量経済分析」、400番台大学院コア科目の「中級計量経済学」と「上級計量経済学」そして「計量経済学特論」、500番台科目の「上級計量経済学」がある。研究面では、マクロ経済活動を時系列的に実証分析する研究、パネル構造データの計量経済学的分析、構造変化の有無の検証などの研究が行われている。

計量ファイナンス関連の講義科目では、導入科目として300番台科目の「金融工学概論」、400番台科目の「中級計量ファイナンス」、「ファイナンス経済論 A・B」、「計量ファイナンス A・B」、「計量ファイナンス特論」がある。研究面では、数理ファイナンス、金融工学、保険数理など多方面の研究が行われている。

上記3分野以外にも情報処理関連の講義科目として、300番台科目の「情報科学総論 A・B」、400番台科目の「情報処理論 A・B」を可能な限り開講し、計量経済学、統計解析、計量ファイナンス等におけるソフトウェア使用の情報科学的側面や、その応用としてのベイズ的統計手法に焦点を当てた授業を開講している。

以上のように経済統計部門は、経済学を学ぶために数量的な分析方法の知識が不可欠であるという認識から、学部生に対する必修あるいは選択必修的な講義、および大学院生に対するコア講義など多くのサービスコース的な講義から専門性のある講義までバラエティーに富む講義を提供している。上記において「・・・特論」という400番台科目は、定期的の開講される科目ではなく、種々の専門的な内容の科目を需要にあわせて提供するものである。

なお、本研究科における統計学・計量経済学の関連科目の系統図は、以下を参照されるとよい。

<http://www.econ.hit-u.ac.jp/~ecosta/course-g.pdf>