

STATAによる計量データ分析の基礎

日時: 3月5日(月)~3月9日(金) 13:00~17:30
場所: 東京大学(本郷)赤門総合研究棟2階 教育学部200番教室
料金: 一般 10,000円、学生 5,000円

講師: 筒井淳也(立命館大学)
秋吉美都(専修大学)
水落正明(三重大学)
福田巨孝(国立社会保障・人口問題研究所)

テキスト: 『STATAで計量経済学入門』ミネルヴァ書房(2007年2月刊行予定)
*必ず購入しなければならないわけではありませんが、購入を推奨いたします

本コースの内容

統計ソフトSTATAを用いた初級~中級レベルの講義です。日本語ではじめての本格的STATAテキストの執筆陣によって、STATAの操作方法から汎用性の高い個別手法にいたるまで、具体的な解説がなされます。統計的な基本知識、ソフトの操作、実質的研究での応用事例を、バランスよく学ぶことができます。

このような方におすすめです

- ・回帰分析を中心に学びたい
- ・計量分析の経験はあるが、STATAは使ったことがない
- ・基本的な分析法は習得したので、次のステップに進みたい

注意事項

マシン実習はありません(講師によるSTATA操作のデモのみです)
本コースには、所属機関などによる受講者制限はありません

本コースの日程

5日 「イントロダクション」、「記述統計と統計的検定」(筒井淳也)
イントロダクション

Stataを利用したデータの扱い方を基礎から説明します。データファイルの開き方・保存法・変換法、アップロード、ログの取り方からはじめて、変数操作(作成・ラベル貼り・ソート・加工など)までを解説します。

記述統計と統計的検定

基本統計量の出力、クロス表のバリエーション、グラフ出力などの記述のためのコマンドから、t検定、カイ二乗検定などの簡単な検定のコマンドを説明します。ごく簡単なプログラムやシミュレーション方法の説明も行います。

6日 「回帰分析基本編」(筒井淳也)、「回帰分析応用編」(秋吉美都)

回帰分析

OLS回帰分析および推計後の診断のためのコマンドの説明を、実際のデータを使って行います。基本コマンドに加えてダミー変数、交互作用項を使った回帰分析、残差分析、多重共線性の診断などをカバーしますが、基本的な出力結果の解釈の仕方を重点的に解説します。

7日 「カテゴリカルデータ分析基本編」、「カテゴリカルデータ分析応用編」(秋吉美都)

カテゴリカルデータ分析

本コースでは、社会科学で広く用いられているカテゴリカルデータの分析方法をカバーします。基礎編ではコンティンジェンシー・テーブルとオッズなど、カテゴリカルデータの記述と整理を扱います。応用編ではロジスティック回帰分析、ログリニアモデルなどのモデルの分析方法をカバーします。

8日 「パネルデータ分析基本編」、「パネルデータ分析応用編」(水落正明)

パネルデータ分析

パネルデータは豊富な情報量を持ち、実証分析において非常に有用なものです。ただし、その反面、扱いに少し手間がいる場面があります。そこで本コースでは、パネルデータの整理の仕方から始めて、記述統計的な分析を丁寧に行い、データの扱いに慣れます。実際のパネルデータ分析では、この段階でも十分に有益な知見が得られるはずですが、そしてさらにモデル選択から回帰分析へと、徐々に発展的な内容に進んでいきます。

9日 「時系列データの分析」(水落正明)、「サバイバル分析」(福田亘孝)

時系列データの分析

時系列データには、クロスセクションデータにはない特性があり、クロスセクションデータと同じように分析すると問題が生じます。本コースでは、そうした時系列データ特有の問題について理解するとともに、時系列データの入手・整理から、検定方法、適切な推定方法について解説する。さらに、自己回帰モデルなどいわゆる「時系列分析」の初歩についても解説します。

サバイバル分析

サバイバル分析は生存時間分析やイベント・ヒストリー分析とも呼ばれ社会科学でよく使われる分析手法です。講義では、 Kaplan-Meier法やログランク検定といったサバイバル分析の基礎からCox比例ハザードモデルや等比性の分析といった多変量による応用までをわかりやすく解説します。