

計量経済 I : 宿題 3

村澤 康友

提出期限 : 2020 年 6 月 2 日 (MyKONAN で提出)

注意 : すべての質問に解答しなければ提出とは認めない。授業の HP の解答例を正確に再現すること (乱数は除く)。グループで取り組んでよいが、個別に提出すること。解答例をコピーしたり、他人の名前で提出した場合は、提出点を 0 点とし、再提出も認めない。すべての結果をワープロに貼り付け、pdf ファイルに変換して提出すること。

1. (教科書 p. 128, 実証分析問題 5-A) gretl で回帰分析を実行する手順は次の通り :

- (a) メニューから「モデル」→「通常の最小二乗法」を選択。
- (b) 「従属変数」を 1 つ選択。
- (c) 「説明変数 (回帰変数)」を選択。
- (d) 「OK」をクリック。

ただ実行して終わるのでなく、データ分析の際は、以下の点に常に注意すること :

分析前 データの数値を確認し、表・グラフ・統計量でデータの特徴を把握する。

分析後 推定値の統計的有意性・符号・大きさを確認し、分析結果を解釈する。

データセット「5_1_income.dta」を gretl に読み込み、教科書 pp. 113-116 の 4 つの単回帰モデルの推定結果を再現しなさい。

2. (教科書 p. 128, 実証分析問題 5-B) データセット「5_2_sleep.dta」を gretl に読み込み、睡眠時間を通勤時間で説明する回帰分析を実行しなさい。

3. (教科書 p. 128, 実証分析問題 5-C) データセット「5_3_abe.dta」を gretl に読み込み、安倍首相 (当時) への支持感情を賃金所得で説明する回帰分析を実行しなさい。

解答例

1. (a) レベル=レベル

モデル 1: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-4327

従属変数: income

	係数	Std. Error	t-ratio	p 値
const	-56.8928	19.3568	-2.939	0.0033
yeduc	23.1510	1.38425	16.72	0.0000
Mean dependent var	263.9040	S.D. dependent var	176.5552	
Sum squared resid	1.27e+08	S.E. of regression	171.1286	
R^2	0.060744	Adjusted R^2	0.060527	
$F(1, 4325)$	279.7095	P-value(F)	6.85e-61	
Log-likelihood	-28389.98	Akaike criterion	56783.96	
Schwarz criterion	56796.70	Hannan-Quinn	56788.46	

(b) ログ=レベル

モデル 2: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-4327

従属変数: lincome

	係数	Std. Error	t-ratio	p 値
const	4.38520	0.100312	43.72	0.0000
yeduc	0.0651801	0.00717354	9.086	0.0000
Mean dependent var	5.288386	S.D. dependent var	0.895150	
Sum squared resid	3401.469	S.E. of regression	0.886830	
R^2	0.018731	Adjusted R^2	0.018504	
$F(1, 4325)$	82.55861	P-value(F)	1.53e-19	
Log-likelihood	-5619.064	Akaike criterion	11242.13	
Schwarz criterion	11254.87	Hannan-Quinn	11246.63	

(c) レベル=ログ

モデル 3: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-4327

従属変数: income

	係数	Std. Error	t-ratio	p 値
const	-515.478	50.0329	-10.30	0.0000
lyeduc	297.534	19.0743	15.60	0.0000
Mean dependent var	263.9040	S.D. dependent var	176.5552	
Sum squared resid	1.28e+08	S.E. of regression	171.8089	
R^2	0.053262	Adjusted R^2	0.053043	
$F(1, 4325)$	243.3176	P-value(F)	2.07e-53	
Log-likelihood	-28407.15	Akaike criterion	56818.29	
Schwarz criterion	56831.04	Hannan-Quinn	56822.79	

(d) ログ=ログ

モデル 4: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-4327

従属変数: lincome

	係数	Std. Error	t-ratio	p 値
const	3.15947	0.258686	12.21	0.0000
lyeduc	0.812727	0.0986204	8.241	0.0000
Mean dependent var	5.288386	S.D. dependent var		0.895150
Sum squared resid	3412.809	S.E. of regression		0.888307
R^2	0.015460	Adjusted R^2		0.015232
$F(1, 4325)$	67.91354	P-value(F)		2.24e-16
Log-likelihood	-5626.264	Akaike criterion		11256.53
Schwarz criterion	11269.27	Hannan-Quinn		11261.03

2. 通勤時間と睡眠時間

モデル 1: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-3726

従属変数: sleep

	係数	Std. Error	t-ratio	p 値
const	431.765	1.29258	334.0	0.0000
commute	-0.553002	0.0314740	-17.57	0.0000
Mean dependent var	413.0825	S.D. dependent var		46.67611
Sum squared resid	7494253	S.E. of regression		44.86001
R^2	0.076551	Adjusted R^2		0.076303
$F(1, 3724)$	308.7091	P-value(F)		1.87e-66
Log-likelihood	-19457.98	Akaike criterion		38919.96
Schwarz criterion	38932.41	Hannan-Quinn		38924.39

3. 賃金所得と支持感情

モデル 1: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-4276

従属変数: abe

	係数	Std. Error	<i>t</i> -ratio	p 値
const	43.4372	0.327738	132.5	0.0000
income	-0.00305935	0.000928663	-3.294	0.0010
Mean dependent var	42.63681	S.D. dependent var	14.40106	
Sum squared resid	884349.4	S.E. of regression	14.38450	
R^2	0.002533	Adjusted R^2	0.002299	
$F(1, 4274)$	10.85278	P-value(F)	0.000995	
Log-likelihood	-17466.84	Akaike criterion	34937.69	
Schwarz criterion	34950.41	Hannan-Quinn	34942.18	