

計量経済 II : 宿題 3

村澤 康友

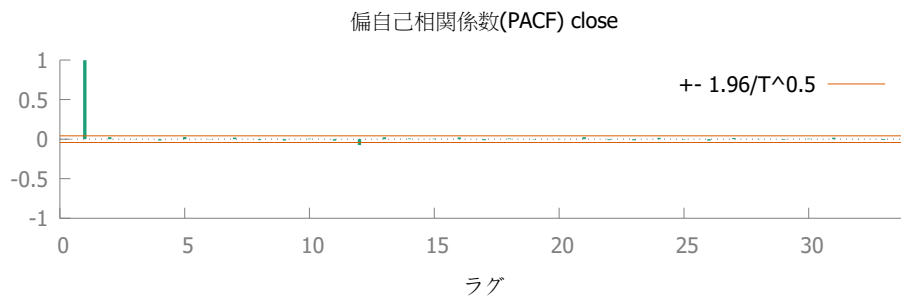
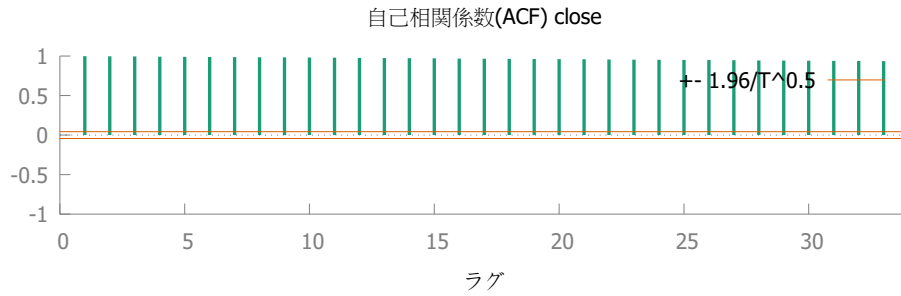
提出期限 : 2020 年 10 月 20 日

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もよいが、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文書に貼り付け、pdf ファイルに変換して提出すること。

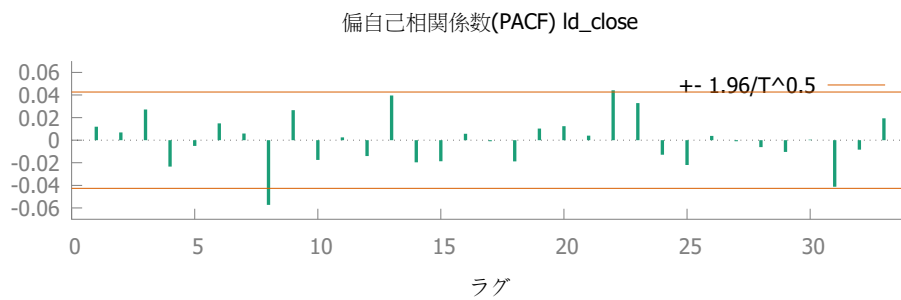
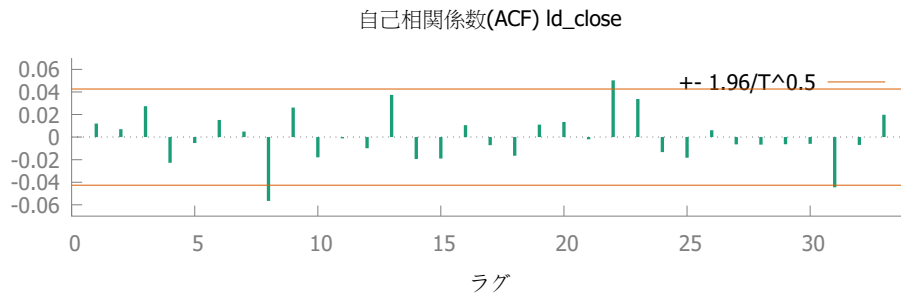
1. gretl のサンプル・データ nysewk は、ニューヨーク証券取引所の株価指数 (NYSE 総合指数) の 1965 ~2006 年の週次データである。
 - (a) 対数系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) 対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
2. gretl のサンプル・データ swisspharma の変数 salesq は、1971 年第 1 四半期~2011 年第 2 四半期のスイスの医薬品販売額のデータである。
 - (a) salesq の対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) salesq の対数の季節階差系列のコレログラムを描きなさい。

解答例

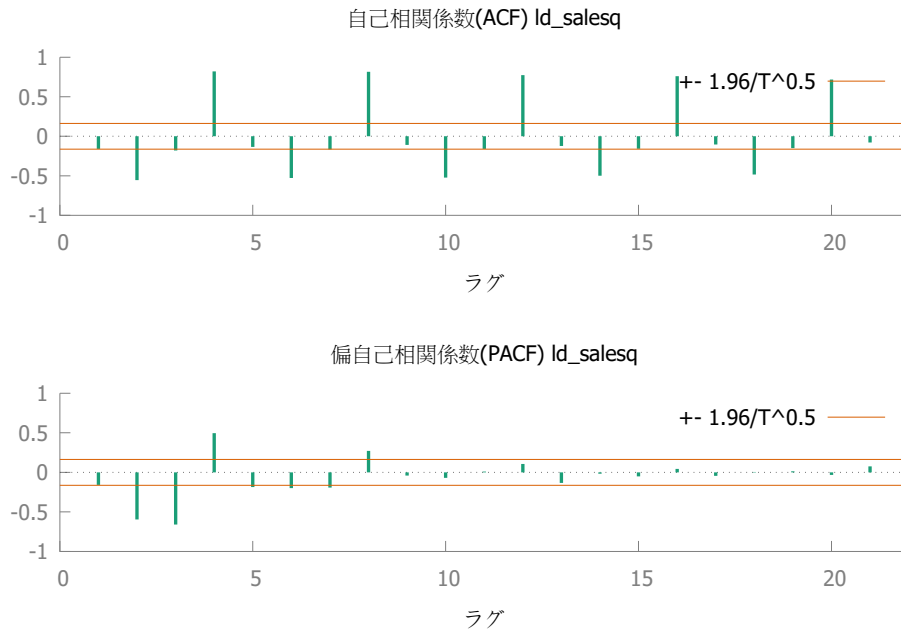
1. (a) 対数系列



(b) 対数階差系列



2. (a) 対数階差系列



(b) 対数の季節階差系列

