

計量経済 II : 宿題 9

村澤 康友

提出期限 : 2020 年 12 月 15 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 sw-ch12 の変数 GDP_JP は 1959 年第 1 四半期～1999 年第 2 四半期の日本の 1 人当たり実質 GDP の季節調整済み系列である。第 1 次オイル・ショック (1974 年第 1 四半期) とバブル崩壊 (1991 年第 2 四半期) の構造変化ダミーを用いて GDP_JP の対数系列の線形トレンドの構造変化を OLS で推定し、結果を図示しなさい。
※ gretl で構造変化ダミーを作成する手順は以下の通り。
 - (a) メニューから「追加」→「観測範囲ダミー」を選択。
 - (b) 「ダミー範囲」を設定し、変数名を入力。
 - (c) 「OK」をクリック。
2. 前問と同じデータを使用する。以下の 2 つの時点について、GDP_JP の対数系列の線形トレンドの構造変化のチョウ検定を実行しなさい。
 - (a) 第 1 次オイル・ショック (1974 年第 1 四半期)
 - (b) バブル崩壊 (1991 年第 2 四半期)※ gretl でチョウ検定を実行する手順は以下の通り。
 - (a) OLS を実行した画面のメニューから「検定」→「チョウ検定」を選択。
 - (b) 「標本を分割する観測」(構造変化の時点) を指定。
 - (c) 「OK」をクリック。

解答例

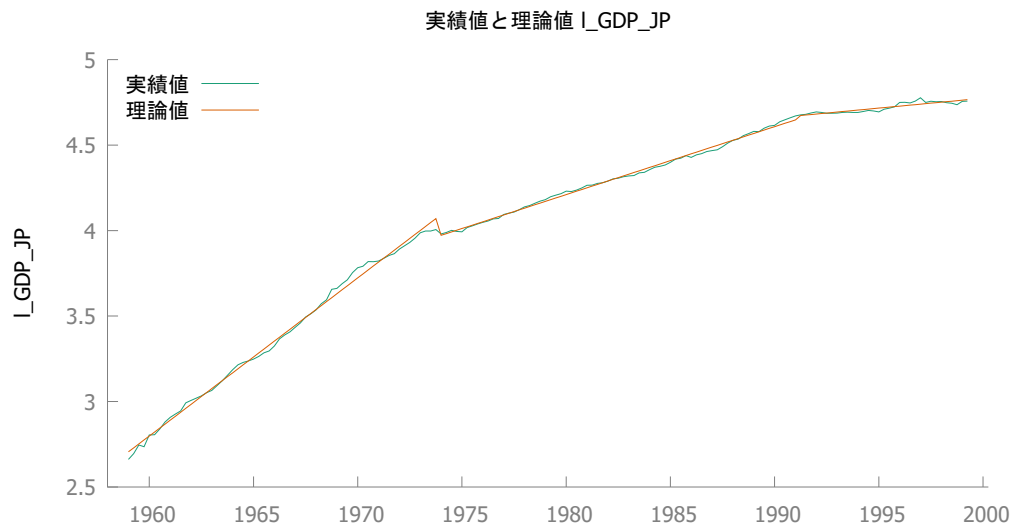
1. 構造変化の回帰分析

モデル 1: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1959:1–1999:2 ($T = 162$)

従属変数: L_GDP_JP

	係数	標準誤差	t-ratio	p 値
const	2.68269	0.00491945	545.3	0.0000
d1	0.683499	0.0120857	56.55	0.0000
d2	0.930776	0.0515238	18.06	0.0000
time	0.0231227	0.000140260	164.9	0.0000
d1time	-0.0131904	0.000180575	-73.05	0.0000
d2time	-0.00703978	0.000362291	-19.43	0.0000
Mean dependent var	4.051760	S.D. dependent var	0.600922	
Sum squared resid	0.055226	S.E. of regression	0.018815	
R^2	0.999050	Adjusted R^2	0.999020	
$F(5, 156)$	32814.03	P-value(F)	9.6e-234	
Log-likelihood	416.8290	Akaike criterion	-821.6581	
Schwarz criterion	-803.1325	Hannan-Quinn	-814.1364	
$\hat{\rho}$	0.765804	Durbin-Watson	0.433666	

線形トレンドの構造変化



2. (a) 第1次オイル・ショック (1974年第1四半期)

チヨウ (Chow) 検定のための拡張された回帰

最小二乗法 (OLS), 観測: 1959:1-1999:2 (T = 162)

従属変数: l_GDP_JP

	係数	標準誤差	t 値	p 値
const	2.68269	0.00971256	276.2	5.13e-214 ***
time	0.0231227	0.000276918	83.50	1.27e-132 ***
splitdum	0.817964	0.0173745	47.08	6.95e-095 ***
sd_time	-0.0146779	0.000303791	-48.32	1.50e-096 ***
Mean dependent var	4.051760	S.D. dependent var	0.600922	
Sum squared resid	0.218028	S.E. of regression	0.037147	
R-squared	0.996250	Adjusted R-squared	0.996179	
F(3, 158)	13991.18	P-value(F)	2.3e-191	
Log-likelihood	305.6009	Akaike criterion	-603.2019	
Schwarz criterion	-590.8515	Hannan-Quinn	-598.1875	
rho	0.975745	Durbin-Watson	0.093901	

F(2, 158) = 1284.99 なお、p 値 (p-value) 0.0000

(b) バブル崩壊 (1991年第2四半期)

チヨウ (Chow) 検定のための拡張された回帰

最小二乗法 (OLS), 観測: 1959:1-1999:2 (T = 162)

従属変数: l_GDP_JP

	係数	標準誤差	t 値	p 値
const	2.93764	0.0197773	148.5	1.27e-171 ***
time	0.0145132	0.000264011	54.97	6.54e-105 ***
splitdum	1.35932	0.299327	4.541	1.10e-05 ***
sd_time	-0.0116207	0.00205837	-5.646	7.45e-08 ***
Mean dependent var	4.051760	S.D. dependent var	0.600922	
Sum squared resid	1.969979	S.E. of regression	0.111661	
R-squared	0.966116	Adjusted R-squared	0.965472	
F(3, 158)	1501.640	P-value(F)	7.3e-116	
Log-likelihood	127.3074	Akaike criterion	-246.6148	
Schwarz criterion	-234.2644	Hannan-Quinn	-241.6004	
rho	0.966986	Durbin-Watson	0.023203	

F(2, 158) = 71.9604 なお、p 値 (p-value) 0.0000