

計量経済 II : 復習テスト 2

学籍番号 _____ 氏名 _____

2020 年 10 月 6 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。正答に修正した上で、復習テスト 1~8 を（左上で）ホチキス止めし、中間試験実施日（12 月 1 日の予定）にまとめて提出すること。

1. 四半期系列 $\{y_t\}$ を季節変動 $\{S_t\}$, 長期傾向 $\{T_t\}$, 循環変動 $\{C_t\}$ に分解する。すなわち

$$y_t = S_t + T_t + C_t$$

D_t^1, \dots, D_t^4 を季節ダミーとし, $S_t := \alpha_1 D_t^1 + \dots + \alpha_4 D_t^4$, $T_t := \beta_0 + \beta_1 t$ とする.

(a) $\Delta_4 S_t$ を求めなさい.

(b) $\Delta_4 T_t$ を求めなさい.

(c) $\Delta_4 y_t$ を求めなさい.

2. 時系列 $\{y_t\}$ は長期傾向 $\{T_t\}$ と循環変動 $\{C_t\}$ に乗法的に分解できる. すなわち $y_t = T_t C_t$. $\{T_t\}$ を初項 T_0 , 公比 $(1+r)$ の等比数列とする.

(a) $\ln y_t$ を T_t と C_t で表しなさい.

(b) T_t の一般項を求めなさい.

(c) $\ln T_t$ の一般項を求めなさい.

(d) $\Delta \ln T_t$ の一般項を求めなさい.

解答例

1. (a)

$$\begin{aligned}\Delta_4 S_t &:= S_t - S_{t-4} \\ &= \alpha_1 D_t^1 + \cdots + \alpha_4 D_t^4 - (\alpha_1 D_{t-4}^1 + \cdots + \alpha_4 D_{t-4}^4) \\ &= \alpha_1 (D_t^1 - D_{t-4}^1) + \cdots + \alpha_4 (D_t^4 - D_{t-4}^4) \\ &= 0\end{aligned}$$

(b)

$$\begin{aligned}\Delta_4 T_t &:= T_t - T_{t-4} \\ &= \beta_0 + \beta_1 t - [\beta_0 + \beta_1(t-4)] \\ &= 4\beta_1\end{aligned}$$

(c)

$$\begin{aligned}\Delta_4 y_t &:= y_t - y_{t-4} \\ &= S_t + T_t + C_t - (S_{t-4} + T_{t-4} + C_{t-4}) \\ &= \Delta_4 S_t + \Delta_4 T_t + \Delta_4 C_t \\ &= 4\beta_1 + \Delta_4 C_t\end{aligned}$$

2. (a)

$$\ln y_t = \ln T_t + \ln C_t$$

(b)

$$T_t = T_0(1+r)^t$$

(c)

$$\ln T_t = \ln T_0 + t \ln(1+r)$$

(d)

$$\begin{aligned}\Delta \ln T_t &:= \ln T_t - \ln T_{t-1} \\ &= \ln T_0 + t \ln(1+r) - [\ln T_0 + (t-1) \ln(1+r)] \\ &= \ln(1+r)\end{aligned}$$