

計量経済 II : 復習テスト 11

学籍番号 _____ 氏名 _____

2020 年 12 月 22 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 9～14 を（左上で）ホチキス止めし，定期試験実施日（1 月 26 日の予定）にまとめて提出すること。

1. 次の行列の階数を調べたい。

$$\mathbf{A} := \begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \end{bmatrix}$$

(a) 各行が線形独立であることを示しなさい。

(b) 各列が線形従属であることを示しなさい。

(c) 列階数が 2 であることを示しなさい。

2. $\{x_t, y_t\}$ を共積分階数 2 の CI(1,1) とする. すなわち任意の t について

$$ax_t + by_t = u_t$$

$$cx_t + dy_t = v_t$$

ただし $\{u_t, v_t\}$ は I(0). このとき $\{x_t, y_t\}$ が I(0) となることを示したい. $\{u_t, v_t\}$ の平均ベクトルを $\boldsymbol{\mu} := (\mu_u, \mu_v)'$, 自己共分散行列関数を $\boldsymbol{\Gamma}(\cdot)$ とする. ただし

$$\boldsymbol{\Gamma}(\cdot) := \begin{bmatrix} \gamma_{uu}(\cdot) & \gamma_{uv}(\cdot) \\ \gamma_{vu}(\cdot) & \gamma_{vv}(\cdot) \end{bmatrix}$$

(a) 連立方程式を解いて (x_t, y_t) を (u_t, v_t) で表しなさい.

(b) 任意の α, β について $\{\alpha u_t + \beta v_t\}$ の平均を $\boldsymbol{\mu}$ で表しなさい.

(c) 任意の α, β について $\{\alpha u_t + \beta v_t\}$ の自己共分散関数を $\boldsymbol{\Gamma}(\cdot)$ で表しなさい.

解答例

1. (a) 次式の解が $a = b = 0$ のみであることを示せばよい.

$$a \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix} + b \begin{pmatrix} 4 \\ 5 \\ 6 \end{pmatrix} = 0$$

連立方程式は

$$a + 4b = 0$$

$$2a + 5b = 0$$

$$3a + 6b = 0$$

a を消去すると

$$-8b + 5b = 0$$

$$-12b + 6b = 0$$

したがって $b = 0$. これを代入すると $a = 0$.

- (b) 次式の解が $a = b = c = 0$ 以外にも存在することを示せばよい.

$$a \begin{pmatrix} 1 \\ 4 \end{pmatrix} + b \begin{pmatrix} 2 \\ 5 \end{pmatrix} + c \begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} = 0$$

連立方程式は

$$a + 2b + 3c = 0$$

$$4a + 5b + 6c = 0$$

a を消去すると

$$4(-2b - 3c) + 5b + 6c = 0$$

すなわち

$$-3b - 6c = 0$$

または

$$b + 2c = 0$$

したがって例えば $(a, b, c) = (1, -2, 1)$ も解となる.

- (c) 例えば次式の解が $a = b = 0$ のみであることを示せばよい.

$$a \begin{pmatrix} 1 \\ 4 \end{pmatrix} + b \begin{pmatrix} 2 \\ 5 \end{pmatrix} = 0$$

連立方程式は

$$a + 2b = 0$$

$$4a + 5b = 0$$

a を消去すると

$$-8b + 5b = 0$$

したがって $b = 0$. これを代入すると $a = 0$.

2. (a) 逆行列を使って解くと

$$\begin{aligned}\begin{pmatrix} x_t \\ y_t \end{pmatrix} &= \frac{1}{ad-bc} \begin{bmatrix} d & -b \\ -c & a \end{bmatrix} \begin{pmatrix} u_t \\ v_t \end{pmatrix} \\ &= \frac{1}{ad-bc} \begin{pmatrix} du_t - bv_t \\ -cu_t + av_t \end{pmatrix}\end{aligned}$$

すなわち

$$\begin{aligned}x_t &= \frac{d}{ad-bc}u_t - \frac{b}{ad-bc}v_t \\ y_t &= -\frac{c}{ad-bc}u_t + \frac{a}{ad-bc}v_t\end{aligned}$$

(b) 任意の t について

$$\begin{aligned}\mathbf{E}(\alpha u_t + \beta v_t) &= \alpha \mathbf{E}(u_t) + \beta \mathbf{E}(v_t) \\ &= \alpha \mu_u + \beta \mu_v\end{aligned}$$

(c) 任意の t, s について

$$\begin{aligned}\text{cov}(\alpha u_t + \beta v_t, \alpha u_{t-s} + \beta v_{t-s}) &= \alpha^2 \text{cov}(u_t, u_{t-s}) + \alpha\beta \text{cov}(u_t, v_{t-s}) + \alpha\beta \text{cov}(v_t, u_{t-s}) + \beta^2 \text{cov}(v_t, v_{t-s}) \\ &= \alpha^2 \gamma_{uu}(s) + \alpha\beta \gamma_{uv}(s) + \alpha\beta \gamma_{vu}(s) + \beta^2 \gamma_{vv}(s)\end{aligned}$$