

計量経済 II：宿題 3

村澤 康友

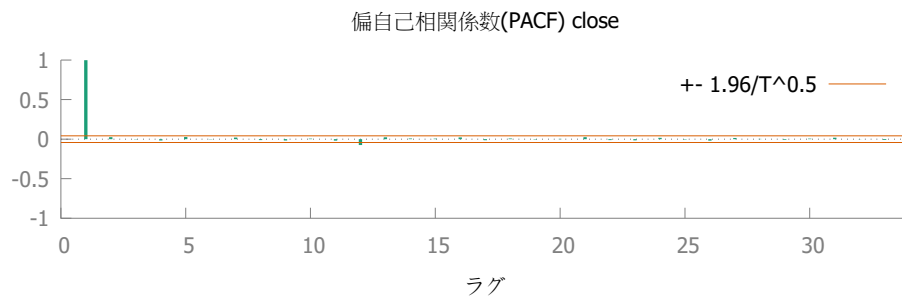
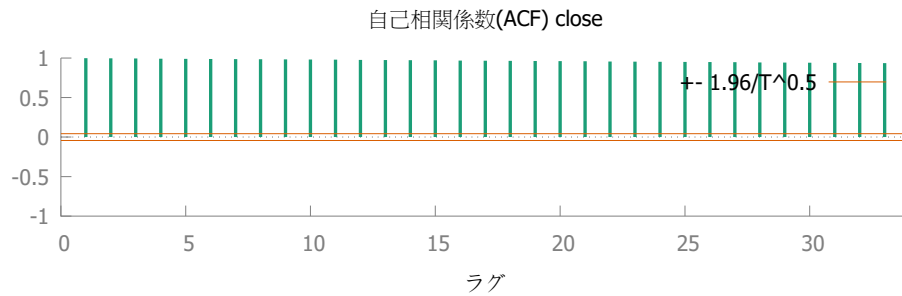
提出期限：2023 年 10 月 16 日

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ドに貼り付けて印刷し（A4 縦・両面印刷可・手書き不可）、2 枚以上になる場合は問題番号順に重ねて左上隅をホッチキスで留めること。

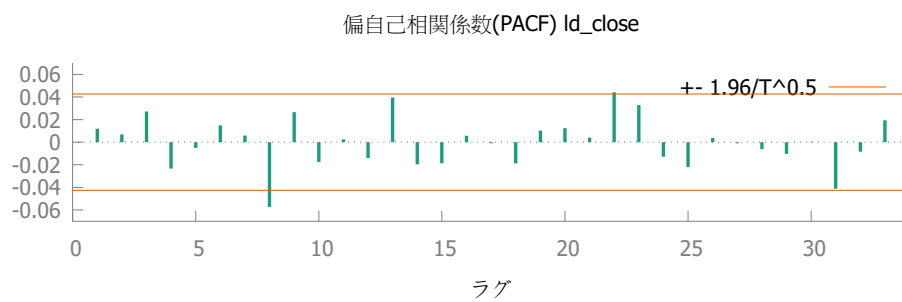
1. gretl のサンプル・データ nysewk は、ニューヨーク証券取引所の株価指数（NYSE 総合指数）の 1965～2006 年の週次データである。
 - (a) 対数系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) 対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
2. gretl のサンプル・データ swisspharma の変数 salesq は、1971 年第 1 四半期～2011 年第 2 四半期のスイスの医薬品販売額のデータである。
 - (a) salesq の対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) salesq の対数季節階差系列のコレログラムを描きなさい。

解答例

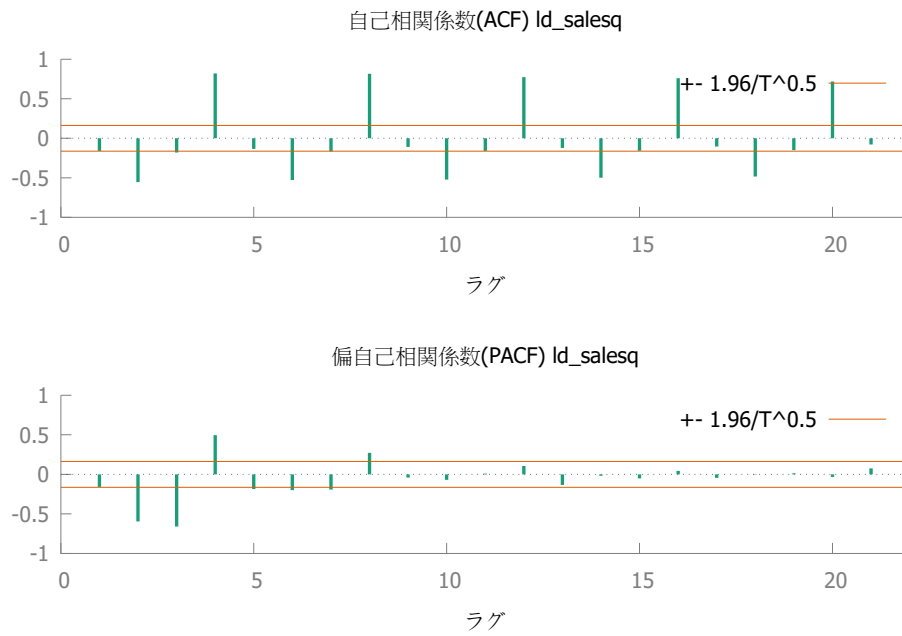
1. (a) 対数系列



(b) 対数階差系列



2. (a) 対数階差系列



(b) 対数季節階差系列

