

計量経済学 練習問題

第12回 単純回帰分析 (7)

2007年11月6日

問 下の分析結果はアメリカの実質個人可処分所得のデータ (これを X とする) と、実質個人消費支出のデータ (これを Y とする) について、 $Y = a + bX$ という回帰分析を TSP でおこなった結果である。

Equation 1

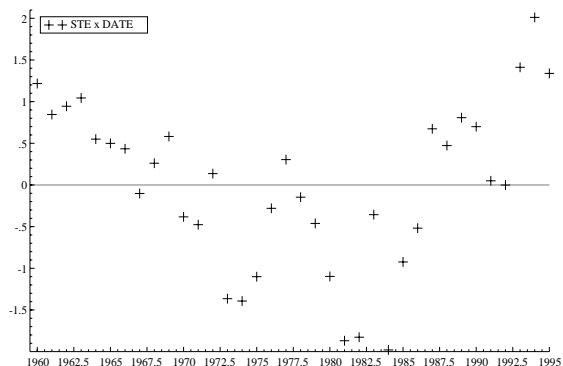
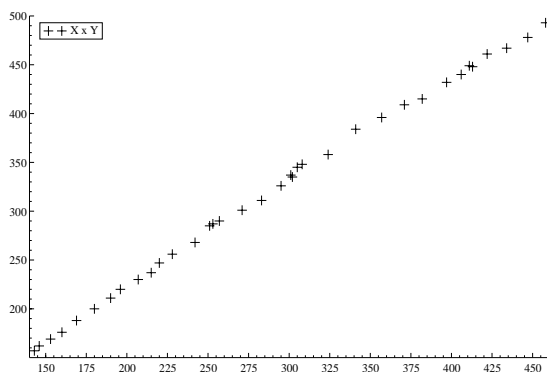
=====

Method of estimation = Ordinary Least Squares

Dependent variable: Y
Current sample: 1960 to 1995
Number of observations: 36

Mean of dep. var. = 289.944	LM het. test = 2.35100 [.125]
Std. dev. of dep. var. = 95.8212	Durbin-Watson = .523428 [.000, .000]
Sum of squared residuals = 693.977	Jarque-Bera test = .964989 [.617]
Variance of residuals = 20.4111	Ramsey's RESET2 = 55.7354 [.000]
Std. error of regression = 4.51786	F (zero slopes) = 15710.4 [.000]
R-squared = .997841	Schwarz B.I.C. = 107.926
Adjusted R-squared = .997777	Log likelihood = -104.342

Variable	Estimated Coefficient	Standard Error	t-statistic	P-value
C	-9.42874	2.50435	-3.76495	[.001]
X	.935866	.746656E-02	125.341	[.000]



(1) 係数推定値の符号が、経済理論に適合しているかどうか検討せよ。

(2) 回帰直線のあてはまりを検討せよ。

(3) 回帰係数が有意であるかどうか検討せよ。