

経済統計 練習問題

第 21 回 回帰分析の諸問題 (1)(6)

2015 年 7 月 1 日

問 次の(あ)～(き)の文章について、正しければ○ 間違っていれば× を解答欄に記入せよ。

- (あ) $Y_t = a + bX_t$ という単回帰分析では、多重共線性の影響を考慮する必要はない。
- (い) $Y_t = a + bX_t + cW_t$ という重回帰分析では、系列相関の影響を考慮する必要はない。
- (う) VIF は不均一分散の存在を判断する指標である。
- (え) ダービン・ワトソン統計量で、0に近い数値が出た場合、系列相関の影響はみられない。
- (お) $Y_t = a + bX_t + cY_{t-1}$ というモデルでは、系列相関の判定にダービン・ワトソン統計量を用いることはふさわしくない。
- (か) 多重共線性が存在するときの根治療法は説明変数を取り除くことである。
- (き) 系列相関が存在するときの根治療法は説明変数を取り除くことである。

解答欄

(あ)	(い)	(う)	(え)	(お)	(か)	(き)