

計量経済学 練習問題

第16回 重回帰分析(3)

2017年6月5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 YD とする)と、実質個人消費支出のデータ(これを CE とする)について、 $CE = a + bYD$ という回帰分析を R でおこなった結果である。

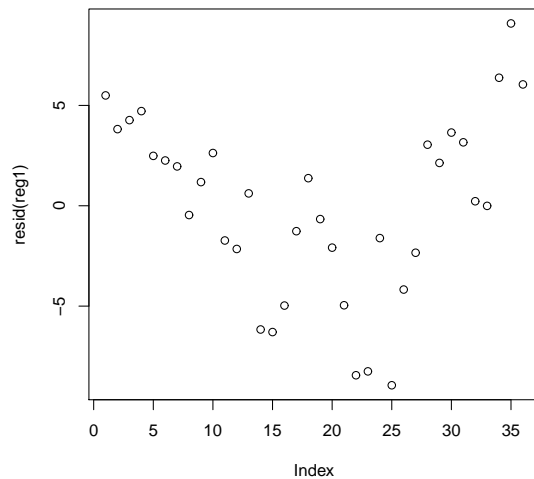
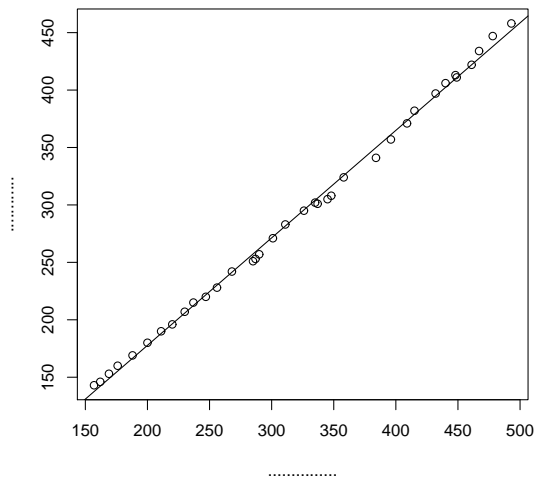
```
Call:
lm(formula = CE ~ YD, data = data1)

Residuals:
    Min       1Q   Median       3Q      Max
-8.9439 -2.1999  0.4207  3.0734  9.0847

Coefficients:
(Intercept)  -9.428745  2.504347  -3.765  0.000632  ***
YD             0.935866  0.007467 125.341  < 2e-16  ***
---
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 4.518 on 34 degrees of freedom
Multiple R-squared:  0.9978,    Adjusted R-squared:  0.9978
F-statistic: 1.571e+04 on 1 and 34 DF, p-value: < 2.2e-16

重決定係数 .....          自由度修正済み決定係数
```



- (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。