

練習問題解答

5章

1. 不均一分散の検定

LM 検定 0.629819 [p 値 0.427]

ホワイト検定 4.60805 [p 値 0.100]

ブロシュ=ペーガン検定 2.57380 [p 値 .109]

より、すべての検定で、「帰無仮説：分散が均一である」を受容

2. 分散は均一であり、ホワイトの分散の一致推定量で検定する必要はない。

3. 系列相関

1 次の系列相関

ダービン・ワトソン検定 1.53888 [p 値 .104,.266]

ブロシュ=ゴドフレー検定 0.464608 [p 値 0.495]

より、一次の系列相関はない。

2 次の系列相関

ブロシュ=ゴドフレー検定 0.198655 [p 値 .905]

より、二次の系列相関はない。

4. 系列相関はないので、ニューイー=ウェストの推定は必要ない。

5. 操作変数法による推定

操作変数を定数項とタイムトレンドとする。

$$INFL = 3.77776 - 0.820203UEMP$$

$$(6.72) \quad (5.94)$$

$$R^2 = 0.755, SE = 0.633, DW = 1.544$$

6. ハウスマン検定

ハウスマン検定統計量 0.1279 p 値 0.93804

より、 $H_0 : E(u|X) = 0$ を受容する。すなわち、最小二乗法はバイアスを持たない。