

平成28年度 九州大学大学院経済学府修士課程入学試験問題(一般選抜)

計 量 経 済 学

次の2問から、1問を選択し解答しなさい。

問1 最小二乗推定量が最良線型不偏推定量であるというガウス＝マルコフ定理について、必要な条件を明示しながら具体的に説明しなさい。

問2 系列相関は、時系列データを用いた計量分析でしばしば生じる問題である。系列相関に関する以下の問題について答えなさい。

- (1) 系列相関が存在する計量モデルに最小二乗法を適用した場合に生じることを説明しなさい。
- (2) 系列相関の存在の検定方法について具体的に説明しなさい。
- (3) 系列相関がある計量モデルに対処するための具体的な方法について、モデル式を設定して説明しなさい。