

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 重回帰モデルに関する以下の各問に答えなさい。

- (1) 季節ダミー変数とはどのようなものであるか、具体例を挙げて説明しなさい。
- (2) 決定係数と自由度修正済み決定係数の違いについて説明しなさい。
- (3) 多重共線性の問題について説明しなさい。
- (4) 説明変数と誤差項に相関があるときには、どのようにしてモデルを推定すればよいか、具体例を挙げて説明しなさい。

問2 差の差の分析 (difference-in-differences analysis) の概要とその具体的な応用例について論じなさい。

