

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 回帰モデルに関する以下の各問に答えなさい。

- (1) 説明変数の内生性とはどのようなものか、具体例を挙げて説明しなさい。
- (2) 説明変数に内生性があるとき、どのような問題が生じるか、説明しなさい。
- (3) (2)を回避するために、どのように推定することが考えられるか、説明しなさい。

問2 回帰モデルに関する以下の各問に答えなさい。

- (1) 誤差項の不均一分散とはどのようなものか、具体例を挙げて説明しなさい。
- (2) 誤差項に不均一分散があるとき、回帰係数に関する区間推定や仮説検定をどのようにして行えばよいか、説明しなさい。
- (3) (2)において、誤差項の不均一分散を考慮しないで分析を行った場合、どのような問題が生じるか、説明しなさい。