

計量経済 II：宿題 3

村澤 康友

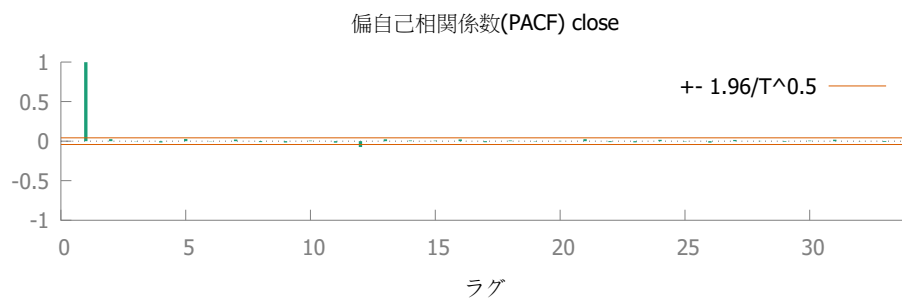
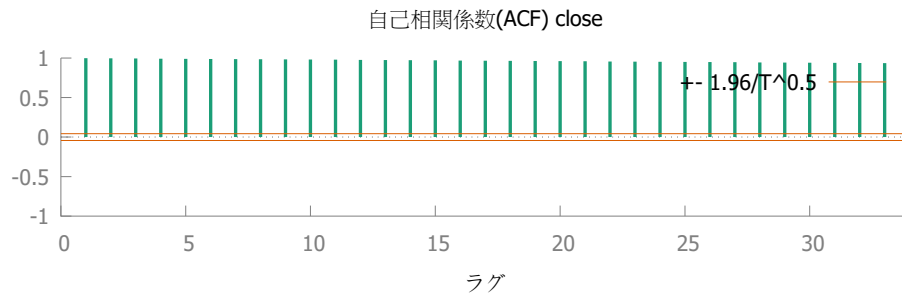
提出期限：2022 年 10 月 18 日

注意：すべての質問に解答しなければ提出とは認めない。授業の HP の解答例を正確に再現すること（乱数は除く）。グループで取り組んでよいが、個別に提出すること。解答例をコピーしたり、他人の名前で提出した場合は、提出点を 0 点とし、再提出も認めない。すべての結果をワープロに貼り付けて、2 枚以上になる場合は、必ず左上隅をホッチキスで留めること。

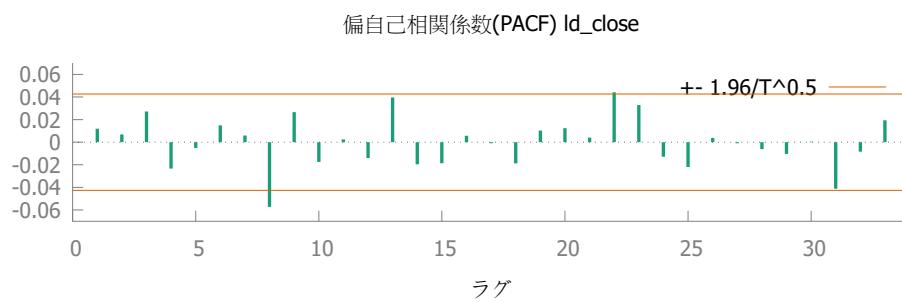
1. gretl のサンプル・データ nysewk は、ニューヨーク証券取引所の株価指数（NYSE 総合指数）の 1965～2006 年の週次データである。
 - (a) 対数系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) 対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
2. gretl のサンプル・データ swisspharma の変数 salesq は、1971 年第 1 四半期～2011 年第 2 四半期のスイスの医薬品販売額のデータである。
 - (a) salesq の対数階差系列のコレログラムを描きなさい。
 - (b) salesq の対数季節階差系列のコレログラムを描きなさい。

解答例

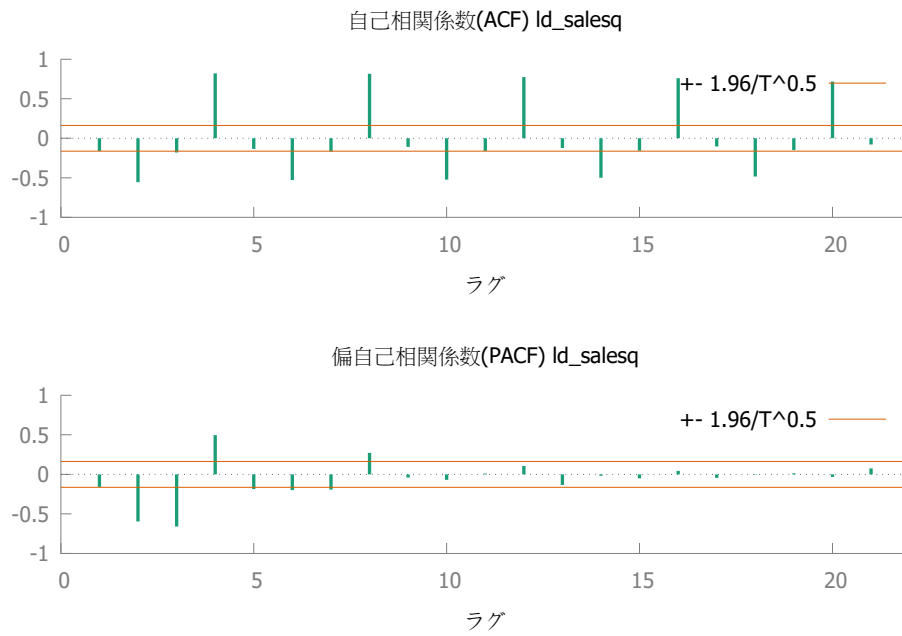
1. (a) 対数系列



(b) 対数階差系列



2. (a) 対数階差系列



(b) 対数季節階差系列

