

定期試験 (7/19, 9:30~11:00) について

為替レート :

$$Exr_t = f(r_t, r_t^*, p_t, p_t^*, B_t, s_t)$$

$r_t, r_t^*, p_t, p_t^*, B_t, s_t$ が Exr_t に与える影響を考えておいて下さい。
ただし、各変数は次のとおり。

Exr_t	t 期の為替レート
B_t	t 期の貿易収支 (= 輸出 - 輸入)
p_t	t 期の物価上昇率
p_t^*	t 期の米国の物価上昇率
r_t	t 期の金利
r_t^*	t 期の米国の金利
s_t	t 期の株価

次の質問に答えられるようにしておいて下さい。

1. 係数の符号はどうなるべきか？
2. R^2 の意味は？
3. R^2 の問題点を含めて、 \bar{R}^2 の意味は？
4. 真の係数の値はどのあたりにあるか？
5. 真の係数の値がゼロという仮説はどのような意味を持つか？
6. 1~5 について、実際に推定した結果、どのような結果が得られたか？

分布表は試験問題に付けます。

なお、持ち込みは「電卓のみ」とします。

課題研究 (レポート) について

具体的には、論文の構成は次のような構成になる。

1. 序文
2. 従来の経済理論
3. 新理論
4. 実証分析
5. まとめ

「1. 序文」では、レポートで何をするのかを書くこと（「2. 従来の経済理論」、
「3. 新理論」、
「4. 実証分析」で行うことを簡単にまとめる）。
====> 最後に書く。

「2. 従来の経済理論」では、関連する経済理論をまとめること（適当な教科書を
何冊か選んで要約すること）。

「3. 新理論」では、「従来の経済理論」もとにして、修正する。

「4. 実証分析」では、「2. 従来の経済理論」と「3. 新理論」で必要なデータをと
ってきて、TSP (または、Excel) で推定し、得られた推定結果の解釈を行う。
====> 「2. 従来の経済理論」と「3. 新理論」の比較を行う。

「5. まとめ」では、どのような「2. 従来の経済理論」を用いて、その理論のど
こを修正して「3. 新理論」を作ったのか、また、得られた実証結果の要約。
====> 1~4 で重なる部分があってもよい。

(注) 「3. 新理論」というのは簡単ではないので、代わりに、「2. 従来の経済理論」
をいくつか選んで、「4. 実証分析」でその比較検討でも可。