

「経済学特論（経済時系列分析入門）」 課題レポート

締め切り: 2020年7月6日, PM23:59:59

- 必ず, 氏名・学籍番号を解答用紙に書いてください。
- tanizaki@econ.osaka-u.ac.jp 宛に解答を送ってください。
- Subject に「時系列」としてください。でなければ, メールがごみ箱に行く可能性があります。

1 回帰式:

$$y_t = x_t\beta + u_t$$

について, $y_t \sim I(1)$, $x_t \sim I(1)$ とする。 u_t の仮定を説明しながら, 下記の問に答えなさい。

- (1) 見せかけ回帰とは何か? どのような問題が起こるのか説明しなさい。
- (2) 共和分回帰とは何か? 見せかけ回帰とは何が異なるのか説明しなさい。