

資産価格の実証分析／金融経済論 II 第 1 回宿題

祝迫得夫

配布： 2008 年 10 月 14 日（火） 提出： 2008 年 10 月 21 日（火）

提出方法

- A. ICS 金融共同研究室もしくは経済研究所教官秘書室に、業務時間内にハードコピーを提出.
 - B. 宿題提出用のアドレス (tiw1@ier.hit-u.ac.jp) に、Word か PDF ファイルで提出. 締め切りは 10 月 21 日 23 時 59 分発信.
1. (CLM 2.2) RW1, RW2, RW3, マルチンゲールは、互いにどのような関係にあるかを議論しなさい. 各モデルの関係をベン図を使って示すこと. また個々のモデルについて具体的な例を挙げなさい.
 2. 祝迫の Web (<http://www.ier.hit-u.ac.jp/%7Eiwaisako/class/class.html>) か ICS のイントラネットの授業のページから、データファイル (HW1dat08.txt) をダウンロードしてください. データファイルには、SM, BG, LW, HI という 4 種類の系列の、1977 年 9 月から 2007 年 12 月までの日次データが収録されています.
 - (a) CLM の第 1 章にならって、4 つの系列について基本等計量を計算して、表にしてください. CLM で報告されている結果と比較して、日本のデータの特徴についてコメントをしてください.
 - (b) それぞれの系列について、自己系列相関係数・Q 統計量などを計算して系列相関の有無に関して検証してください.
 - (c) それぞれの系列について、AR(p)モデルを推定して下さい. 特にラグの次数 p に関してなぜその長さを用いたかと、係数の標準誤差の計算の方法について議論してください.