

ラグを含んだ式

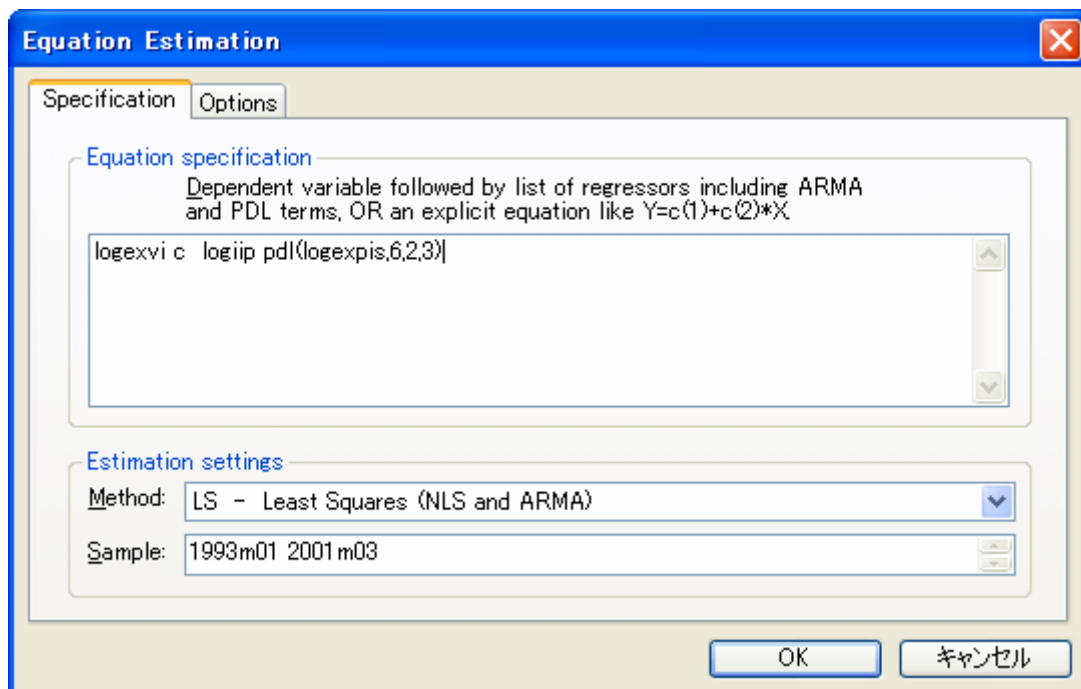
コイックラグは、被説明変数の1期前を説明変数とするものだ。

アーモンラグ

アーモンラグは、変数にラグを仮定するもので、分析者は、ラグ数、制約条件を決める必要がある。制約条件とは、ラグのウエートの形を決めるもので、1なら直線、2なら2次曲線、3なら3次曲線にしたがうようなウエートになる。制約は入力しなくてもよいが、その変数の近いほうのウエートをゼロにする場合は near (EViews の入力では 1)、遠い方のウエートをゼロにする場合は far (同 2)、両方に制約を置く場合は both (同 3) を選ぶ。

EViews の入力では、説明変数を入力する際、次のように表記する。

P D L (変数名、ラグ数、次数、(制約))



Dependent Variable: LOGEXVI
 Method: Least Squares
 Date: 02/28/06 Time: 12:54
 Sample (adjusted): 1993M07 2001M03
 Included observations: 93 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	4.433323	0.027106	163.5553	0.0000
LOGIIP	0.424596	0.069163	6.139043	0.0000
PDL01	-0.060526	0.013358	-4.530899	0.0000
R-squared	0.673246	Mean dependent var	4.687882	
Adjusted R-squared	0.665984	S.D. dependent var	0.092374	
S.E. of regression	0.053387	Akaike info criterion	-2.990784	
Sum squared resid	0.256513	Schwarz criterion	-2.909087	
Log likelihood	142.0714	F-statistic	92.71814	
Durbin-Watson stat	0.826966	Prob(F-statistic)	0.000000	
Lag Distribution of LOGEXPIS	i	Coefficient	Std. Error	t-Statistic
* .	0	-0.05296	0.01169	-4.53090
* .	1	-0.09079	0.02004	-4.53090
* .	2	-0.11349	0.02505	-4.53090
* .	3	-0.12105	0.02672	-4.53090
* .	4	-0.11349	0.02505	-4.53090
* .	5	-0.09079	0.02004	-4.53090
* .	6	-0.05296	0.01169	-4.53090
	Sum of Lags	-0.63552	0.14026	-4.53090

期待を織り込んだ推計

適応的期待

適応的期待とは、望ましい変数（長期的均衡値）と現実の変数がある比率を持って調整されるモデルである。

望ましい水準を y^* 、現実の値を y とすると次の式で表すことができる。

$$y_t^* - y_{t-1}^* = (y_t - y_{t-1}^*)$$

合理的期待

合理的期待形成とは、経済主体の予測はその時点までの情報をすべて取り入れて行っており、誤差がでるのは、予測できないショックだけであるという考え方である。

$$y=a+bx+e$$

x を y の期待値とすると、誤差はランダムになるはずだというものである。

部分調整モデル

雇用調整モデルは次の式を想定する。

$$y_t = y_{t-1} + \lambda (y_t^* - y_{t-1})$$

誤差修正モデル

エラーコレクションモデルは次の式で定式化できる。