

『EViews で学ぶ実証分析の方法』

第3章 正誤表

- 104 ページ : (3.2)式

$$(誤) \quad y_t = e^{z_t} k_t^\alpha l_t^{1-\alpha} \Rightarrow (正) \quad y_t = A e^{z_t} k_t^\alpha l_t^{1-\alpha}$$

追記 : ここで定数 A は定常状態における技術水準を示します。

- 106 ページ : (3.8)式

$$(誤) \quad -(\alpha - 1)\alpha y / (k\gamma) \Rightarrow (正) \quad -\beta(\alpha - 1)\alpha y / (k\gamma)$$

- 108 ページ : 上から9行目

追記 : ε_t は i.i.d 過程に従う確率ショック(1 変数)です。

- 109 ページ :

$$(誤) \quad \begin{bmatrix} \tilde{p}_{11} & \tilde{p}_{12} \\ \tilde{p}_{21} & \tilde{p}_{22} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \tilde{b}_{11} & \tilde{b}_{12} \\ \tilde{b}_{21} & \tilde{b}_{22} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \tilde{p}_{11} & \tilde{p}_{12} \\ \tilde{p}_{21} & \tilde{p}_{22} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{bmatrix}$$

$$\Rightarrow (正) \quad \begin{bmatrix} \tilde{b}_{11} & \tilde{b}_{12} \\ \tilde{b}_{21} & \tilde{b}_{22} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \tilde{p}_{11} & \tilde{p}_{12} \\ \tilde{p}_{21} & \tilde{p}_{22} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & 0 \\ 0 & \lambda_2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} p_{11} & p_{12} \\ p_{21} & p_{22} \end{bmatrix}$$

- 109 ページ : 注 10 最初の行列

$$(誤) \quad \begin{bmatrix} p_{11} & p_{12} \\ p_{21} & p_{22} \end{bmatrix} \Rightarrow (正) \quad \begin{bmatrix} \tilde{p}_{11} & \tilde{p}_{12} \\ \tilde{p}_{21} & \tilde{p}_{22} \end{bmatrix}$$

追記 : \tilde{p}_{i1} 、 \tilde{p}_{j2} が \tilde{b} の行列の固有ベクトルとなります。

- 109 ページの「そこで、以下のような変数変換を考えます。」という文章以降、111 ページ最後までの数式中の \tilde{p}_{ij} は全て p_{ij} となります(注 10 は除く)。
- 111 ページ : (3.23)式

$$(誤) \quad x_{t+1} = \lambda_1 x_t + \left(p_{11} - p_{12} \frac{p_{21}}{p_{22}} \right)^{-1} c_1' \varepsilon_t$$

$$\Rightarrow (正) \quad x_{t+1} = \lambda_1 x_t + \left(p_{11} - p_{12} \frac{p_{21}}{p_{22}} \right)^{-1} \left(c_1' - \frac{p_{12} c_2' \lambda_1}{p_{22} \lambda_2} \right) \varepsilon_t$$

これにより、すぐ下の α_2 の表現も変わります。

- 112 ページ : 2.2 節の上から3行目

$$(誤) \quad E_t[x_{t+1}] = \alpha_1 x_t \Rightarrow (正) \quad E_t[x_{t+1}] = \alpha_1 x_t + \alpha_2 \varepsilon_t$$

- 114 ページ : 表 3.1

k と c の行を削除(これらの数値は定常状態モデルから含意されます)。

- 115 ページ : プログラム 3.1

$$(誤) \quad (3.29) \text{式の解を求める} \Rightarrow (正) \quad (3.30) \text{式の解を求める}$$

第3章 練習問題解答 正誤表

- 練習問題解答 1 ページの最後の式

$$(\text{誤}) \quad \hat{k}_{t+1} = \lambda_1 \hat{k}_t + \left(p_{11} - p_{12} \frac{p_{21}}{p_{22}} \right)^{-1} \left(c'_1 + \frac{c'_2 \rho}{p_{22}(\lambda_2 - \rho)} \right) z_t$$

$$\Rightarrow (\text{正}) \quad \hat{k}_{t+1} = \lambda_1 \hat{k}_t + \left(p_{11} - p_{12} \frac{p_{21}}{p_{22}} \right)^{-1} \left(c'_1 - \frac{p_{12} c'_2 \lambda_1}{p_{22}(\lambda_2 - \rho)} + \frac{p_{12} c'_2 \rho}{p_{22}(\lambda_2 - \rho)} \right) z_t$$

追記：練習問題(1)の設定の場合、線形化されたオイラー方程式は下記になります。

$$\hat{c}_t - E_t \left(\hat{c}_{t+1} - \frac{\beta \alpha (\alpha - 1) y}{k \gamma} \hat{k}_{t+1} - \frac{\beta \alpha \gamma \rho}{k \gamma} z_t \right) = 0$$

したがって、(3.8)式に相当する数式は下記のようになります。

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 \\ -\beta \alpha (\alpha - 1) y / (k \gamma) & 1 \end{bmatrix} E_t \begin{bmatrix} \hat{k}_{t+1} \\ \hat{c}_{t+1} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 - \delta + \alpha y / k & -c / k \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \hat{k}_t \\ \hat{c}_t \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} y / k \\ \beta \alpha \gamma \rho / (k \gamma) \end{bmatrix} z_t$$