

2025 年度 大学院秋季入試（経済学専攻）

博士課程（前期）

専門科目 計量経済学

【合否判定の方法】

《外国語科目》《専門科目》《面接》

提出書類および外国語試験、専門科目、面接の成績を総合的に評価し、合否を判定する。

【合否判定の基準】

提出書類および各試験の結果を総合的に評価し、研究計画の妥当性および博士課程における研究遂行能力を有しているかを判断する。

1 試験日 2024 年 10 月 12 日

2 科目 計量経済学（100 点満点）

3 出題意図

本試験問題は、計量経済学の基礎理論の理解、統計的推論の運用能力、および実証分析結果の解釈力を総合的に評価することを目的として構成している。

問題 1

最小二乗法の基本的枠組み（目的関数の設定、一階条件、正規方程式）を理解しているかを確認する。

問題 2

「不偏性・一致性・効率性」の定義を、言葉および数式により簡潔に説明できるかを評価する。また、それぞれの性質に対応する仮定を整理できるかを確認するとともに、一致性の証明を通じて、OLS 推定量の成立に必要な諸仮定との関連性を理解できているかを確認する。

問題 3

推定係数を単なる統計量としてではなく、経済的意味（解釈）として適切に説明できるかを評価する。特に、対数変換モデルにおける弾力性および準弾力性の違いを区別できるかを確認する。

問題 4

多変量回帰において説明変数を追加すればモデルが常に改善されるわけではないことを理解しているかを確認し、モデル選択の基礎的理解を評価する。

問題 5

推定結果表から検定統計量および信頼区間を適切に導出できるかを確認する。

また、自由度および t 分布の臨界値を用いた統計的推論を正しく運用できるかを評価する。

問題 6

ダミー変数の係数の意味（基準群との比較）を理解し、「統計的に有意でない」ことの含意を適切に説明できるかを確認する。

問題 7

二次項を含む回帰モデルにおける限界効果（一次項と二次項の関係）を理解しているかを確認する。また、交互作用項（ダミー変数と他の説明変数の積）の係数がグループ間の傾きの差を表すことを説明できるかを評価する。さらに、現実の地価形成を踏まえた説明変数の候補を挙げ、その理由を適切に示すことができるかにより、応用的な分析力を評価する。

以上