

## ダミー変数の種類

### ■ 定数項ダミーと係数ダミー

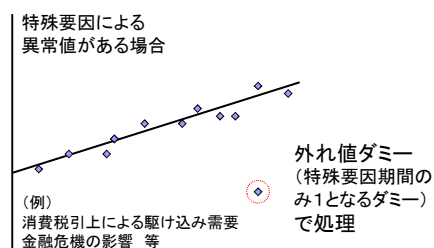
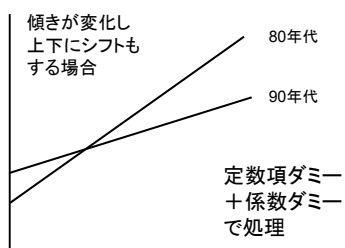
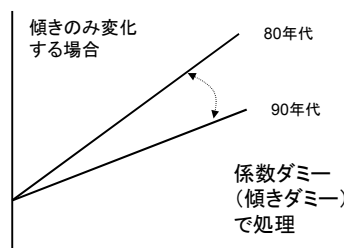
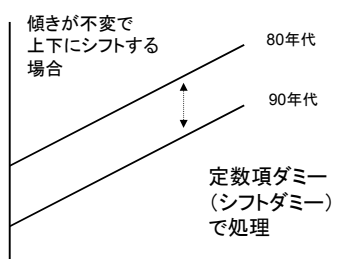
- 定数項ダミー(切片ダミー)・・・水準のシフト
- 係数ダミー(傾きダミー)・・・説明変数の影響の大きさ(傾き)の変化

### ■ 構造変化ダミー、季節ダミー、外れ値ダミー

- 構造変化ダミー・・・80年代と90年代の変化等
- 季節ダミー・・・季節変動の処理
- 外れ値ダミー(異常値ダミー)・・・特定の時点の特異な動き(ex.消費税導入の年等)の処理

63

## 定数項ダミー、係数ダミー、外れ値ダミー



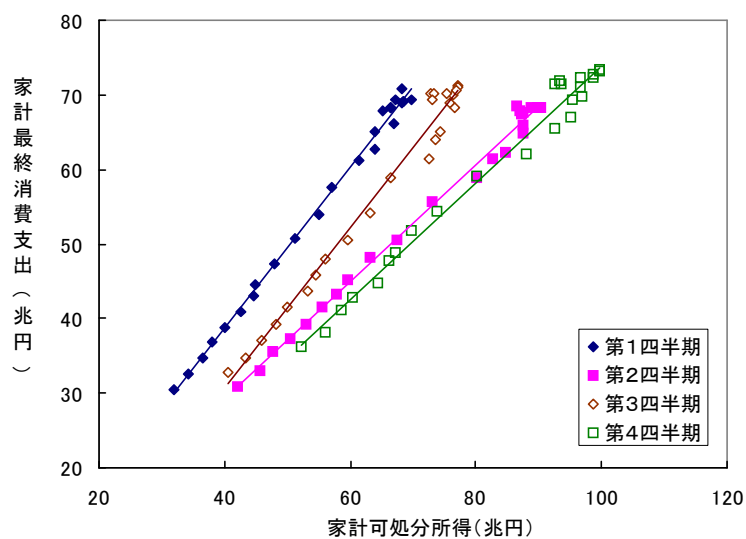
64

## 季節変動と季節ダミー

- 月次、四半期などのデータを用いて推定する場合、季節変動の影響を除いて推定するにはどうするか
- 方法1：季節調整済データを用いて推定する  
※ ただし、季節調整済データが利用可能でない統計もある
- 方法2：季節ダミーを用いて推定する  
(例) 四半期データの場合
  - $D_1$ : 第1四半期に1、その他は0の値をとるダミー変数
  - $D_2$ : 第2四半期に1、その他は0の値をとるダミー変数
  - $D_3$ : 第3四半期に1、その他は0の値をとるダミー変数
  - $D_4$ : 第4四半期に1、その他は0の値をとるダミー変数

65

## 所得と消費の季節変動



66