

“Dynamic Panel Data Model and Moment Generating Function” by Yoshitsugu Kitazawa の日本語の要旨

「動学的パネルデータモデルと積率母関数」

要旨

この論文が提唱するのは動学的パネルデータモデルを一致推定するための新しい積率条件のセットである。これらのセットは動学的パネルデータモデルに対する誤差項の積率母関数を解くことから得られ、現時点までに提唱されたいくつかの良く知られた積率条件のセットと関連性を持っている。これらのセットに基づいた GMM 推定量についての小標本特性を調べるために、モンテカルロ実験が実行された。モンテカルロ実験が示すのは、これらのセットのいくつかに基づいた GMM 推定量はいわゆる「調整パラメータ」のいくつかの値に対して良い小標本特性を示しているということである。

キーワード： 動学的パネルデータモデル、一般化積率法、積率母関数、モンテカルロ実験、小標本特性

The paper and Monte Carlo simulator are available from the site:

<http://www.ip.kyusan-u.ac.jp/J/keizai/kitazawa/UPB/upb.html>