

## 『経済・ファイナンスデータの計量時系列分析』誤植リスト\*

1. 24 ページ 4 行目  
「 $+\theta_1 \varepsilon_{t-k}$ 」を「 $+\theta_1 \varepsilon_{t-k-1}$ 」に修正
2. 30 ページ 9 行目  
「 $\phi_1 \text{Cov}(y_{t-1}, \varepsilon_t)$ 」を「 $2\phi_1 \text{Cov}(y_{t-1}, \varepsilon_t)$ 」に修正
3. 30 ページ下から 8 行目  
「 $\text{Cov}(\phi_1 y_{t-1}, y_{t-j}) + \text{Cov}(\varepsilon_t, y_{t-k})$ 」を「 $\text{Cov}(\phi_1 y_{t-1}, y_{t-k}) + \text{Cov}(\varepsilon_t, y_{t-k})$ 」に修正
4. 36 ページ 14 行目  
「その解は  $z = -0.5, 1$  となる」を「その解は  $z = -2, 1$  となる」に修正
5. 37 ページ下から 2 行目  
「2.2.1 項の結果を用いると」を「2.1.1 項の結果を用いると」に修正
6. 42 ページ 3 行目から 2.3.1 項の終わりまでを別ファイルのように修正
7. 45 ページ 7 行目  
「 $f_{Y_3|Y_2, Y_1, Y_0}(y_3|y_2, y_1, y_0; \boldsymbol{\theta}) \cdot f_{Y_2, Y_1|Y_0}(y_2, y_1|y_0; \boldsymbol{\theta})$ 」を「 $f_{Y_3|Y_2, Y_1, Y_0}(y_3|y_2, y_1, y_0; \boldsymbol{\theta}) \cdot f_{Y_2, Y_1|Y_0}(y_2, y_1|y_0; \boldsymbol{\theta})$ 」に修正
8. 46 ページ 15 行目から 2.3.2 項の終わりまでを以下のように修正  
「最後に、最尤推定量の性質を定理としてまとめておこう.

**定理 2.5 (最尤推定量の性質)** ARMA 過程における最尤推定量は以下の性質をもつ.

- (1) 最尤推定量は一致推定量である.
- (2) 最尤推定量を基準化したものは漸近的に正規分布に従う.
- (3) 最尤推定量は一致推定量のなかで漸近的に最小の分散共分散行列をもつ.

性質 (1) と (2) は OLS と同様の望ましい性質である. 性質 (3) は最尤法の漸近有効性を示しており, 分布の仮定が正しければ, 最尤法が最も有効な方法であることを意味するものである.]

9. 50 ページ 15 行目  
「Schwartz 情報量規準」を「Schwarz 情報量規準」に修正
10. 64 ページ 4 行目  
「 $\text{MSE}(\hat{y}_{t+1|t})$ 」を「 $\text{MSE}(\hat{y}_{t+2|t})$ 」に修正
11. 78 ページ 5 行目  
「自己相関」を「自己共分散」に修正
12. 78 ページ 7 行目  
「 $\boldsymbol{\rho}_k = \boldsymbol{\Phi}_1 \boldsymbol{\rho}_{k-1} + \cdots + \boldsymbol{\Phi}_p \boldsymbol{\rho}_{k-p}$ 」を「 $\boldsymbol{\Gamma}_k = \boldsymbol{\Phi}_1 \boldsymbol{\Gamma}_{k-1} + \cdots + \boldsymbol{\Phi}_p \boldsymbol{\Gamma}_{k-p}$ 」に修正

\*第何刷かによって, すでに修正済みのものがあります. また, その関係で行数に多少ずれがある場合がありますので, ご注意ください.

13. 78 ページ 19 行目  
「OLS によって推定した係数推定量は最良線形不偏推定量となること」を「OLS によって推定した係数推定量は漸近有効性をもつこと」に修正
14. 87 ページ 3 行目  
「互いに相関する部分と無相関な部分に分割」を「互いに無相関な攪乱項に分解」に修正
15. 87 ページ 4 行目  
「無相関な部分だけに」を「互いに無相関な攪乱項に」に修正
16. 87 ページ 5 行目  
「互いに相関する部分と無相関な部分に分割」を「互いに無相関な攪乱項に分解」に修正
17. 87 ページ 8 行目  
「互いに相関する部分と無相関な部分に分割」を「互いに無相関な攪乱項に分解」に修正
18. 87 ページ 11 行目  
「互いに相関する部分と無相関な部分に分解したとき、無相関な部分は」を「互いに無相関な攪乱項に分解したとき、互いに無相関な攪乱項は」に修正
19. 126 ページ下から 6 行目  
「説明変数と被説明変数の (少なくともどちらか一方の) ラグ変数」を「被説明変数のラグ変数」に修正
20. 164 ページ 13 行目から 17 行目  
「具体的には、CCC モデルでは  $\cdots \mathbf{A}$  と  $\mathbf{B}$  は  $n \times n$  対角行列である」を「具体的には、CCC モデルでは、まず  $\mathbf{H}_t$  の対角成分だけを本章で紹介したいいずれかの 1 変量 GARCH モデルを用いてモデル化する. この対角成分のモデルを行列の形で

$$\mathbf{D}_t = \text{diag}(h_{11,t}, \dots, h_{nn,t})^{1/2}$$

と表わすことにする。」に修正

21. 165 ページ (7.20) を

$$\mathbf{R}_t = \text{diag}(q_{11,t}, \dots, q_{nn,t})^{-1/2} \mathbf{Q}_t \text{diag}(q_{11,t}, \dots, q_{nn,t})^{-1/2}$$

に修正

22. 165 ページ下から 2 行目  
「 $a > 0, b > 0, a + b \leq 1$ 」を「 $a \geq 0, b \geq 0, a + b < 1$ 」に修正
23. 166 ページ 8 行目  
「 $a > 0, b > 0, a + b \leq 1$ 」を「 $a \geq 0, b \geq 0, a + b < 1$ 」に修正
24. 169 ページ (7.24)  
「 $\mathbf{D}_t^{1/2} \boldsymbol{\varepsilon}_t$ 」の部分を「 $\mathbf{D}_t \boldsymbol{\varepsilon}_t$ 」に修正
25. 179 ページ 1 行目  
「 $G(s_t; \gamma c_1, c_2)$ 」の部分を「 $G(s_t; \gamma, c_1, c_2)$ 」に修正

26. 183 ページ 12 行目

$$\left[ s_t^* = \begin{cases} 1 & s_{t-1} = 1, s_{t-2} = 1 \\ 2 & s_{t-1} = 2, s_{t-2} = 1 \\ 3 & s_{t-1} = 1, s_{t-2} = 2 \\ 4 & s_{t-1} = 2, s_{t-2} = 2 \end{cases} \right] \text{ を } \left[ s_t^* = \begin{cases} 1 & s_t = 1, s_{t-1} = 1 \\ 2 & s_t = 2, s_{t-1} = 1 \\ 3 & s_t = 1, s_{t-1} = 2 \\ 4 & s_t = 2, s_{t-1} = 2 \end{cases} \right] \text{ に修正}$$