

# 国士舘大学大学院入学試験問題用紙

修士課程

研究科	専攻	試験科目	参考書等持込
経済学研究科	経済学専攻	計量経済学	不可

## 問題

説明変数が非確率変数であり、誤差が互いに独立に平均ゼロ、分散均一の確率分布に従う線形単回帰モデルを想定しよう。このモデルの母回帰係数の推定量を被説明変数の線形結合によって一つ作成しなさい。ただし、その期待値が推定対象となる母回帰係数に一致し、分散が最小になるように線形結合すること。また、解答の際、どの母回帰係数の推定量として確率変数を作り出すかを先に示した上で、その過程について、記号の説明から得られた結論まで順を追って丁寧に説明すること。