

課題 2 2012 年度 金融経済論 1 (担当塩路)

期限 : 11 月 27 日 (火) 授業終了直後

講義ホームページ上の `dorn2.m` を参考にして、講義資料にある「トービンの q モデル」における生産性ショックの影響を分析したい。具体的には、

パラメーター B の値が第 0 期に 1 単位だけ増加した。

その後、 B の値は次の式に従って推移した : $B_{t+1} = \rho \cdot B_t$

(ただし ρ は 1 より小さい正の定数)

と仮定する。資本ストック K とトービンの q のインパルス応答関数を求めて図示せよ。

計算するために使用したコード、計算結果の打ち出し、インパルス応答関数の図を提出すること。