

課題 5 2012 年度 金融経済論 1 (担当塩路)

期限 : 2 月 8 日 (金) 塩路研究室ドアのところ

WEB にアップされている Kiyotaki-Moore モデルのシミュレーション・コード `kiyotakimoore1.m` では、担保制約の強さを表すパラメーター τ の値が 1 に固定されていた。他のパラメーターの値をすべて一定に保ったまま、 τ の値を 0.9、1、1.1 と変えてみて、それぞれの設定の下での生産性ショックに対するインパルス応答関数を求めよ (モデルだけでなく定常状態も変わることに注意すること)。異なった設定の下での各変数のインパルス応答関数を、変数ごとに 1 枚のグラフで表せ。(ループの機能を使うこと)

用いた Matlab コードと、結果のグラフを提出すること。