
DUMMY(EXCLUDE,PREFIX=名前) 系列 [リスト あるいは 名前のリスト] ;

機能 :

DUMMYは、インプット系列によってとられるいろいろな値に対応して一組の 0-1 変数を発生します。生成されたダミー変数の数は (EXCLUDEが指定されない限り) インプット系列のユニークな値の数と同じです。

使用法 :

DUMMYの後に系列名を付けると、NAMEを系列名としたときに NAME1,NAME2,等の変数が生成される事になります。別な名前を接頭詞として用いるばあいは、PREFIX= オプションを使って下さい。もしインプット系列がなかったり、FREQ Q あるいは FREQ M が有効の場合は、四半期あるいは月次ダミーが Q1-Q4あるいは M1-M12の名前で生成されます。

生成されたダミーの数は通常インプット系列で与えられたユニークな数に等しいので、使った系列が一定の数の値を持つかどうかには注意して下さい。離散変数でなく連続変数をインプットとして用いた場合は、生成されたダミーの数は観測値の数に等しくなりますから、領域配分がたぶん問題となるでしょう。

ダミー変数を全部使うと、線形回帰においては定数項 (切片) と共線関係になることはよく知られています。もしダミーをこのような定数と一緒に用いたい場合には、EXCLUDEオプションで変数の一つを除いたセットを作成することができます。この場合生成された変数の数は、インプット系列で与えたユニークな値の数から 1 を引いたものになります。

オプション :

EXCLUDE/NOEXCLUDE は、最後のダミー変数をリストから除きます。このオプションは、もしリストを定数項付の回帰で用いる場合には (多重共線性を防ぐために) 便利です。

PREFIX= ダミー変数に名前を付けるための接頭詞です。既定値はインプット系列の名前になります。

例 :

```
FREQ Q ; SMPL 75:1 85:4 ; DUMMY ;
```

は、(四半期ダミー) Q1,Q2,Q3,Q4を生成します。生成された系列は次のような値になります :

観測値	Q1	Q2	Q3	Q4
75:1	1	0	0	0
75:2	0	1	0	0
75:3	0	0	1	0
75:4	0	0	0	1
76:1	1	0	0	0
76:2	0	1	0	0
.
.

```
FREQ M ; SMPL 75:1 84:12 ; DUMMY(EXCLUDE) ;
```

DUMMY

は (M12を除いた月次ダミー)M1-M11を生成します.

次の例は変数, SIZE, からダミーリストを生成し, それは3つの値 0, 2, 3.5 をとります.

```
DUMMY SIZE SDLIST ;
```

これは次のステートメントと同じです.

```
SIZE1 = SIZE = 0 ;  
SIZE2 = SIZE = 2 ;  
SIZE3 = SIZE = 3.5 ;  
LIST SDLIST SIZE1-SIZE3;
```

次の例は, 72 から 91 の数値をとる変数 YEARがあるとして, パネルデータに対する1組の年ダミーを作成します.

```
DUMMY YEAR YEAR72-YEAR91 ;
```

このコマンドは20個のダミー変数: YEAR72, YEAR73, YEAR74, 等を作成します.

バランスデータに対する個々のダミーを作成するには, TRENDとINT()を用います. AR1の例を参照して下さい.

アウトプット :

一組のダミー変数はデータ領域に保存され, (もし指示されていれば) リスト名がダミーセットに対する変数名として定義されます.