
PARAM パラメータ名 [値 パラメータ名 値] ;

機能:

PARAM は非線形推定のプロシジャーでパラメータを指定し、それらに初期値を与えるために用いられます。PROBIT, TOBIT, SAMPSEL, と LOGIT でパラメータに初期値を与えるには @START ベクトル; を用います。より詳しくはそれらのプロシジャーを参照して下さい。

使用法:

PARAM の後に (TSP の引数の制限によってのみ制約をうけますが) 必要なだけのペアにした引数をおきます。各ペアは、パラメータ名とそれに与えられる数値になります。パラメータ名は新しいものでも以前に定義された変数でも構いません。数値は省略することが出来ます。その場合は変数に、それが新しいものであればゼロの値が、あるいは既に定義されたものであればその値がそのまま残されます。(注) キーワードの C と CONSTANT はパラメータとして使ってはいけません。

PARAM ステートメントによって定義されるパラメータの値を推定するプロシジャーは、非線形単一方程式と多重方程式最小二乗法 (最小距離推定を含む) に対する LSQ と FIML です。他のプロシジャーではすべてパラメータを、PARAM ステートメントかその後の推定のどちらかによって与えられた数値を持つ、定数 (スカラー変数) として取り扱います。FORM(PARAM) はパラメータを作成するのに使うことができます。

例:

非線形推定での共通の問題は、一つあるいはそれ以上のパラメータが高度に非線形な形でモデルにはいる場合があります、よい初期値を与えないと推定がむずかしくなることです。この例では、モデルの一部分のパラメータをもう一つのパラメータ、DELTA の値、を条件付きで推定し、それから全てのパラメータと一緒に再推定しています。

```
FRML INVEQ I = LAMBDA*I(-1) + ALPHA*GNP/(DELTA+R) ;
PARAM LANBDA ALPHA ;
CONST DELTA 15 ;
LSQ INVEQ ;
PARAM DELTA ;
LSQ INVEQ ;
```

2回目の LSQ が終わったとき、LANBDA と ALPHA の初期値は最初の推定で得られたものになります。一方 DELTA の初期値は 15 であり、これは CONST ステートメントで与えられています。

アウトプット:

PARAM はなにもアウトプットしません；パラメータと同じタイプのデータ領域の名前の変数を保存します。