

Danmarks Statistik  
MODELGRUPPEN

Per Bremer Rasmussen  
Britt Andresen

Arbejdsrapport\*

22. oktober 1991

## Lønrelationen ADAM oktober 1991

**Resumé:**

---

c:\tekst\lnaokt91.wpt

Nøgleord:

I det foregående papir om lønrelationen<sup>1</sup> blev der estimeret en række forskellige lønrelationer med forskelligt prisudtryk i wedge-variablen, og omfanget af simultanitetsbias blev undersøgt. Alle estimationer løb frem til og med 1990.

Konklusionen fra papiret samt efterfølgende møder var, at man skulle satse på en relation med  $pxn$  i wedgen, hvor direkte og indirekte skatter blev behandlet symmetrisk.

Som følge af en betydelig simultanitetsbias ved anvendelse af  $pyfn$  i wedgen blev der i papiret fokuseret på relationer estimeret med simultan estimation. Der er imidlertid ikke nogen væsentlig simultanitetsbias når  $pxn$  anvendes, og det er derfor valgt at tage udgangspunkt i relation 5 i stedet for relation 9. Som det fremgår af papiret er der ingen forskel på parametrene af økonomisk betydning.

Da alle relationerne i papiret blev estimeret frem til og med 1990 er der nedenfor vist en estimation af relation 5 udelukkende på endelige tal, dvs. frem til og med 1987. Pga. parameterstabiliteten er der ikke nogen væsentlige ændringer, og der er derfor ikke foretaget nye multiplikatoreksperimenter. Figurer for parameterstabilitet og chow-test er vist i figur 1.

---

<sup>1</sup>Per Bremer Rasmussen og Britt Andresen. ADAM's lønrelation: Wedge-specifikation og simultan estimation. *Arbejdsrapport fra Modelgruppen*, 15. juni 1991.

Det foreslås at indlægge følgende relation i ADAM:

$$DLlna = 0.40734 \cdot 0.5 \cdot \log \left( \frac{pcp}{pcp_{-2}} \right)$$

(0.122)

$$+ 0.1495 \cdot 0.5 \left[ \log \left( \frac{pcp}{pcp_{-2}} \right) - \log \left( \frac{pxn}{pxn_{-2}} \right) \right]$$

(0.137)

$$- 0.1495 \cdot 0.5 \log \left( \frac{1-tss0u}{1-tss0u_{-2}} \right)$$

(0.137)

$$+ 0.18703 \cdot \log \left( \frac{kqyfn}{kqyfn_{-1}} \right)$$

(0.118)

$$- 0.14610 \cdot \log \left( \frac{lnak_{-2}}{pyfn_{-2} \cdot kqyfn_{-2}} \right)$$

(0.118)

$$- 0.76364 \cdot bul_{-1}$$

(0.122)

$$+ 0.16632 \cdot btyd_{-1} - 0.05679$$

(0.041) (0.066)

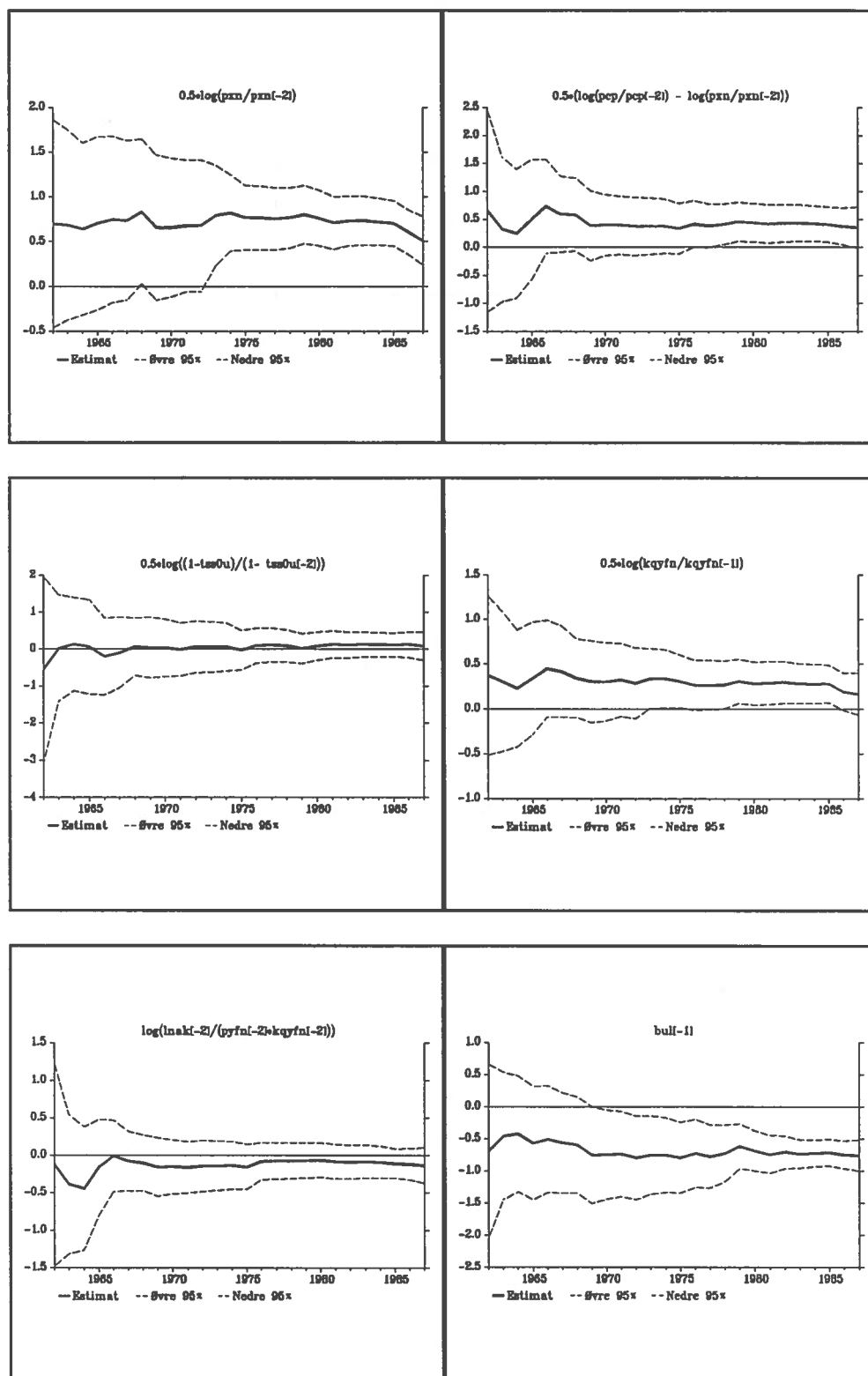
(spredning i parentes)

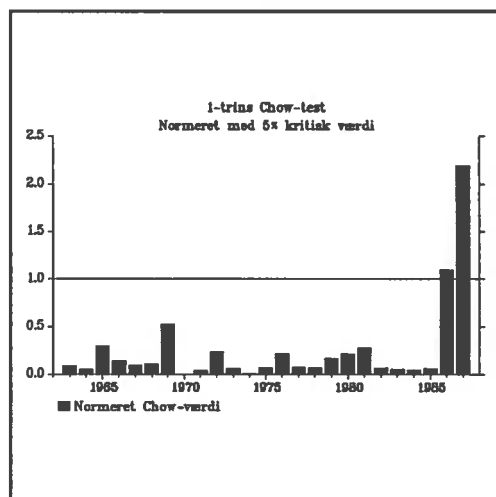
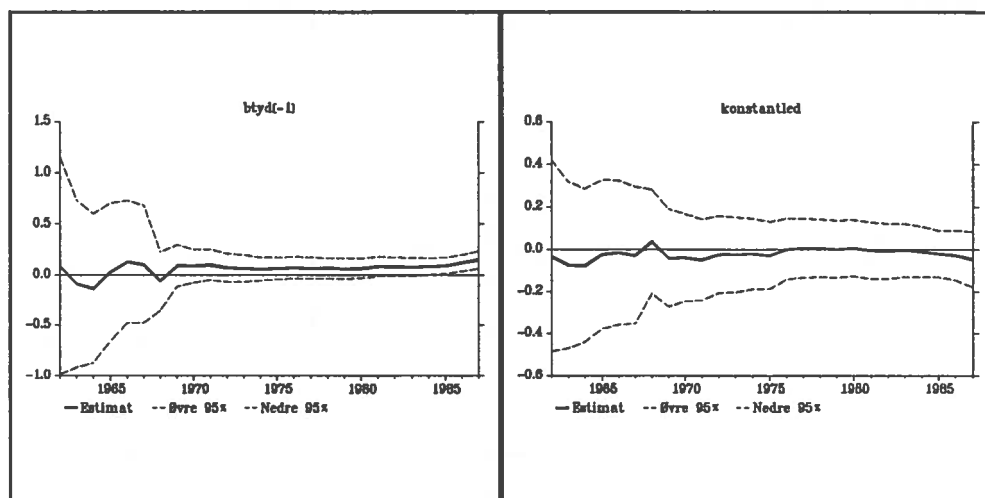
s	0.0155
R <sup>2</sup>	0.8578
LM(1)	6.2874 <sup>2</sup>
LM(2)	9.2775 <sup>3</sup>

<sup>2</sup> Den kritiske værdi er 3.841 på et 5 pct. signifikansniveau.

<sup>3</sup> Den kritiske værdi er 5.991 på et 5 pct. signifikansniveau.

Figur 1: Parameterstabilitet og chow-test





## Appendix A: Modelformler ADAM oktober 1991, løndelen

FRML IBTYD	BTYD	= (TTYD*LIHTY*HA(-1))/84665)/(LNA*HA) \$
FRML IKQYFN	KQYFN	= 1000*FYFN/((QNGA+QNEA+QNFA+QNNA+QNBA+QNMA+QNTA +QNKA+QNQA)*HGN+(QNGF+QNEF+QNF+QNNF+QNB+QNM +QNTF+QNK+QNF)*HA*(1-(BQNF/2))) \$
FRML IPYFN	PYFN	= (YFNG+YFNE+YFNF+YFNN+YFNB+YFNM+YFNT+YFNK+YFNQ)/FYFN \$
FRML GTSSOU	TSSOU	= TSSO + JTSSOU \$
FRML FLNA	LNA	= DLNA*LNA(-1)*EXP(JDLLNA) + (1-DLNA)*LNA(-1)*EXP(.40734*.5*(LOG(PXN)-LOG(PXN(-2))) + .14950*.5*(LOG(PCP/PXN)-LOG(PCP(-2)/PXN(-2))) - .14950*.5*(LOG(1-TSSOU)-LOG(1-TSSOU(-2))) + .18703*.5*(LOG(KQYFN)-LOG(KQYFN(-1))) - .14610*LOG(LNAK(-2)/(PYFN(-2)*KQYFN(-2))) - .76364*BUL(-1) + .16632*BTYD(-1) - .05679 + JDLLNA) \$
FRML ILAH	LAH	= LNA*HA \$
FRML GLNF	LNF	= LNF(-1)*((LAH/LAH(-1))+JRLNF)+JDLNF \$
FRML GLOH	LOH	= LOH(-1)*((LAH/LAH(-1))+JLLOH)+JLLOH \$
FRML ILNAHK	LNAHK	= LNA*HGN/(1-BQN/2) + TAQW + TAQP + TADF + TQU + TDU + JLNAHK \$
FRML ILNFHK	LNFHK	= LNF/(1-BQNF/2) + TAQW + TAQP + TQU + TDU + JLNFHK \$
FRML ILOHK	LOHK	= LOH + TAQW + TAQO + 2/3*TQU + TDU + JLOHK \$
FRML GLIH	LIH	= LIH(-1)*(LNA/LNA(-1))+JRLIH) \$
	( )	
FRML ILNAK	LNAK	= LNAHK*(1-BQN/2)/HGN \$
FRML GYWA	YWA	= LNFHK*QA*(1-BQA/2)*.001*KLA \$
FRML GYWE	YWE	= LNFHK*QE*(1-BQE/2)*.001*KLE \$
FRML GYWNG	YWNG	= (LNAHK*QNGA*(1-BQNGA/2)+LNFHK*QNGF*(1-BQNGF/2))* .001*KLNG \$
FRML GYWNE	YWNE	= (LNAHK*QNEA*(1-BQNEA/2)+LNFHK*QNEF*(1-BQNEF/2))* .001*KLNE \$
FRML GYWNF	YWNF	= (LNAHK*QNFA*(1-BQNFA/2)+LNFHK*QNF*(1-BQNF/2))* .001*KLNF \$
FRML GYWNN	YWNN	= (LNAHK*QNNA*(1-BQNNA/2)+LNFHK*QNNF*(1-BQNNF/2))* .001*KLNN \$
FRML GYWNB	YWNB	= (LNAHK*QNBA*(1-BQNBA/2)+LNFHK*QNB*(1-BQNB/2))* .001*KLNB \$
FRML GYWNM	YWNM	= (LNAHK*QNMA*(1-BQNMA/2)+LNFHK*QNM*(1-BQNM/2))* .001*KLNM \$
FRML GYWNT	YWNT	= (LNAHK*QNTA*(1-BQNTA/2)+LNFHK*QNTF*(1-BQNTF/2))* .001*KLNT \$
FRML GYWNK	YWNK	= (LNAHK*QNKA*(1-BQNKA/2)+LNFHK*QNK*(1-BQNK/2))* .001*KLNK \$
FRML GYWQ	YWQ	= (LNAHK*QQA*(1-BQQA/2)+LNFHK*QQA*(1-BQQA/2))* .001*KLQA \$
FRML GYWQB	YWB	= (LNAHK*QBA*(1-BQBA/2)+LNFHK*QBF*(1-BQBF/2))* .001*KLB \$
FRML GYWQH	YWH	= LNFHK*QQA*(1-BQQA/2)*.001*KLQA \$
FRML GYWQS	YWS	= LNFHK*QQA*(1-BQQA/2)*.001*KLQA \$
FRML GYWQT	YWQT	= LNFHK*QQA*(1-BQQA/2)*.001*KLQA \$
FRML GYWQF	YWQF	= LNFHK*QQA*(1-BQQA/2)*.001*KLQA \$
FRML GYWQQ	YWQQ	= LNFHK*QQA*(1-BQQA/2)*.001*KLQA \$
FRML GYWH	YWH	= LNFHK*QH*(1-BQH/2)*.001*KLH \$
FRML GYWO	YWO	= LOHK*QO*(1-BQO/2)*.001 \$
FRML IYW	YW	= YWA + YWE + YWNG + YWNE + YWNF + YWNN + YWNB + YWNM + YWNT + YWNK + YWNG + YWB + YWQH + YWQS + YWQT + YWQF + YWQQ + YWH + YWO \$