

E-mail: [nabe@ier.hit-u.ac.jp](mailto:nabe@ier.hit-u.ac.jp)

内線: X8347

## 概要

本講義の目的は中・上級レベルのミクロ・マクロ経済理論および中級レベルの計量経済学の手法を用い(1)家計の消費決定行動に関する理論を理解し、(2)家計消費に関わる実証分析手法を修得し、(3)実際にデータを用いて諸仮説の検証ができるようになることである。

家計消費は経済学の諸分野の中でも最も古くからミクロ・マクロ両データを駆使した本格的な推計が行われてきた。初期のミルトン・フリードマン達による消費関数論争、ロバート・ホールによるマルチンゲール仮説、そして近年のアンガス・ディートンやリチャード・ブランデル達及び彼らの影響を受けた精緻なミクロ計量分析、あるいはマクロ一般均衡分析が現在も精力的に行われている。家計消費は、ミクロ・マクロのどのレベルの教科書にもかならず出てくるが、それだけ、優れた研究者たちにより非常に多くのエネルギーが費やされてきた。また、日本の研究者による、日本のデータを用いた重要な貢献も少なくない。

しかしながら、家計消費分析の全体像を把握することは容易ではない。非常に長い歴史と労力をかけられたために、分析手法は高度化し、その基になる理論は様々な分野にまたがり、蓄積された研究成果は膨大な数にのぼる。そして、現在も大きく進化・発展しており、特に構造系の分析を理解するには、上級レベルのミクロ経済学および最先端のミクロ計量手法、あるいは動的最適化の数値解析技法の修得が必要になっている。また、誘導系の分析であっても、その背後には高度な経済理論があるケースが多く、それまでの分析の経緯を知らないと、論文の価値を正しく評価することは困難である。

本講義では、現在の家計消費分析のフロンティアを理解するために必要なミクロ・マクロの家計消費理論、動的最適化の数値解析技法、計量分析手法を中心に紹介し、どのような課題が残されているか、現在どのような分析が進められているかを議論する。

## 受講に際しての前提

受講者は動的計画法や中級レベル(できれば上級レベル)のミクロ・マクロ理論および計量経済学の知識を有していることを前提とする。もっとも、授業では適宜それらについても復習を兼ねてカバーしていく。

評価: 学期末に提出するレポートに基づき行う

講義は独自の講義ノートに基づいて進めるため特に教科書は指定しないが、下記の本の内容は参考になる。

Deaton, A. S. and J. Muellbauer (1980), *Economics and consumer Behavior*, Cambridge University Press, New York

Deaton (1992) *Understanding Consumption*, Oxford.

Deaton (1997) *The Analysis of Household Surveys*, Johns Hopkins.

Tullio Jappelli and Luigi Pistaferri (2018) *The Economics of Consumption Theory and Evidence*, Oxford University Press.

阿部修人 (2011) 『家計消費の経済分析』 岩波書店

## 講義予定

- 第一回 消費理論の基礎: 選好関係、弱分離可能性、集計問題
- 第二回 静学分析: 需要関数の推計、AIDS
- 第三回 動学理論の基本と最適化
- 第四回 動的計画法の数値解法 後ろ向き帰納法、Endogenous Grid
- 第五回 完備資本市場下における家計消費とその検証
- 第六回 不完備市場: 恒常所得・ライフサイクルモデル
- 第七回 消費の過剰反応
- 第八回 予備的貯蓄
- 第九回 流動性制約
- 第十回 所得過程の推定
- 第十一回 消費・所得のライフサイクルプロファイル
- 第十二回 家計消費支出データの変動と計測誤差
- 第十三回 消費者物価指数と数量指数の経済理論
- 第十四回 予備(余裕があれば、指数理論の展開について話します)