

【課題】消費関数の形については、「消費関数論争」と呼ばれるようにさまざまな仮説が存在している。

- | | |
|-------------------------|---|
| ① ケインズ型消費関数（絶対所得仮説） | $C_t = a + bY_t$ |
| ② デューゼンベリー型消費関数（相対所得仮説） | $\frac{C_t}{Y_t} = a + b \frac{Y_t}{Y_0}$ |
| ③ ブラウン型消費関数（習慣仮説） | $C_t = a + bY_t + cC_{t-1}$ |
| ④ トービン型消費関数（金融資産仮説） | $C_t = a + bY_t + cAS_{t-1}$ |
| ⑤ フリードマン型消費関数（恒常所得仮説） | $C_t = a + bYP_t + cYT_t$ |

※ ここで、**C** は消費、**Y** は所得、**AS** は金融資産を表し、**Y₀** は過去の所得の最高の値、**YP** は恒常所得、**YT** は変動所得をあらわす。

これらの消費関数について、**TSP** を用いて実証分析をおこない、考察してみよう。

☞ 提出期限 1月16日(火) 17:00

※ 提出は直接でも、**e-mail** にて提出でもどちらでもかまわない。

☆ データについて

consume.xls は上の消費関数を分析するために必要なデータセットである。分析に用いるデータは、本来自分で収集・加工すべきものであるが、今回は時間制約の関係上、あらかじめデータセットを用意した。

そこで、このデータセットを作成した方法を示しておく。

・内閣府経済社会総合研究所の中にある、国民経済計算年報（平成 16 年度版）のデータを用いた。
(URL: <http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/h16-nenpou/16annual-report-j.html>)

CE (実質家計最終消費支出) … 第 1 部フロー編 4. 主要系列表 (1)国内総支出 実質 暦年において、1 (1) 家計最終消費支出のデータを用いた。

Y (実質家計可処分所得) … 第 1 部フロー編 2. 制度部門別所得支出勘定 (5)家計 において、暦年(2)のシートの 2. 4 可処分所得 (純) のデータを実質化したものを用いた。

実質化は、名目家計最終消費支出 (**CE** の名目のデータ) を実質家計最終消費支出で割ったものを 100 倍したデフレーターを求め、このデータをデフレーターで割って 100 倍した。

AS (実質家計金融資産) … 第 2 部ストック編 2. 制度部門別勘定 (4)家計 (個人企業含む) において、2. 金融資産のデータを実質化したものを用いた。

実質化は、**Y** の実質化と同様の方法でおこなった。

Y₀ (実質家計可処分所得の過去の最大の値) … **Y** のその年以前の最大の値を求めた。Excel の IF 関数を用いた。詳細は **consumeorg.xls** を参照のこと。

YP (恒常所得)、**YT** (変動所得) … **Y** について 3 項移動平均をとったものを **YP**、その残りを **YT** とした。詳細は **consumeorg.xls** を参照のこと。