

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

※ ここで、**CE** 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11日（金）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が作成している、国民経済計算年報（平成 16 年度版）のデータ¹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（**C** 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。

¹ 2007 年 12 月の時点で利用できる最新のデータは平成 18 年度版(平成 16(2004)年までのデータを収録したものであるが、平成 17 年度版から平成 12 年基準に基準改定され、1996 年以降のデータしか公表されていない。そのため、1980 年から公表されている旧基準の平成 16 年度版のデータを用いることにする。