

【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、Y<sub>0</sub> 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、R を用いて実証分析をおこない、考察してみよう。

✎ 提出期限 7月19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.csv** 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、『2009 年度 国民経済計算 確報』のデータを用いた。

(URL: [http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/data/data\\_list/kakuhou/files/h21/h21\\_kaku\\_top.html](http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/data/data_list/kakuhou/files/h21/h21_kaku_top.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)国内総生産 (支出側) 実質(連鎖方式) 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 (個人企業を含む) 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 (個人企業を含む) 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。

Y<sub>0</sub> (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.xlsx** 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.xlsx** を参照のこと。