



Title	代表的個人モデルの集計上の誤謬：消費の実証分析 に与える影響について
Author(s)	平田，憲司郎
Citation	大阪大学，2007，博士論文
Version Type	
URL	https://hdl.handle.net/11094/49054
rights	
Note	著者からインターネット公開の許諾が得られていない ため、論文の要旨のみを公開しています。全文のご利 用をご希望の場合は、大阪大学の博士論文につい てをご参照ください。

The University of Osaka Institutional Knowledge Archive : OUKA

<https://ir.library.osaka-u.ac.jp/>

The University of Osaka

氏 名 ^{ひら}平 ^た田 ^{けん}憲 ^じ司 ^{ろう}郎

博士の専攻分野の名称 博 士（経済学）

学 位 記 番 号 第 2 1 5 4 1 号

学 位 授 与 年 月 日 平成 19 年 9 月 26 日

学 位 授 与 の 要 件 学位規則第 4 条第 1 項該当

経済学研究科経済理論専攻

学 位 論 文 名 代表的個人モデルの集計上の誤謬：消費の実証分析に与える影響について

論 文 審 査 委 員 （主査）

教 授 本多 佑三

（副査）

教 授 池田 新介 准教授 福田 祐一

論 文 内 容 の 要 旨

代表的個人モデルには、数多くの単純化のための仮定が置かれている。その結果、代表的個人モデルは、理論・実証において扱いやすいという長所をもつ。他方、その単純化のための仮定が現実には満足されていないことも多く、それが現実のデータによって観察される事実と理論の間の乖離を生み出す要因になりうる。本論は、単純化の仮定のうち、2つの仮定すなわち「世代間で利他的な関係が存在する」という仮定と「時間選好率が経済主体間で等しい」という仮定を緩めた場合に、それぞれの仮定の緩和により理論モデルがどのように修正され、それにより実際の消費の推定がどのような影響を受けるのかについて検討している。

第1章は、実証分析に用いられる理論モデルを展望している。家計内で利他的な関係がない場合のモデルや、時間の経過とともに時間選好率が変化するモデルなどを展開することにより、実証分析への理論的基礎を提供している。

世代間の利他性の仮定が満足されず、世代間の生涯所得格差がある場合に、代表的個人モデルを用いてモデル化すると誤差が生ずるが、第2章はこの誤差を理論的に特定し、それについて実証している。

第2章では日本のデータを用いて、第3章ではアメリカのデータを用いて、既述の誤差の効果が有意に効いていることなどを実証している。さらに、日米両国において、近年になるにつれて、この誤差は小さくなる傾向があることを示している。

代表的個人モデルでは時間選好率は一定であると仮定されるが、第4章ではこの仮定を緩めたモデルを提示した上で、このことをデータで検証している。その結果、すべての年齢階層で時間選好率が等しいという帰無仮説は強く棄却される。また、時間選好率は若年期から中年期にかけて低下し、中年期から老年期にかけて上昇することを、データを用いて示している。この結論は、代表的個人モデルにおいて採用されている、「時間選好率は一定」という仮定が現実には妥当していないことを示唆するものである。

論文審査の結果の要旨

本論は、代表的個人モデルの単純化の仮定における2つの仮定をとりあげ、再検討している。それぞれの論点において仮定を緩めた理論モデルを展開し、実証し、これら2つの仮定が無視しえない過度の単純化となっていることを論証した。また、年齢別の時間選好率の推定値など、興味深いパラメータの推定値も得ている。論文は、博士（経済学）の水準に達していると判断する。