

1 計量経済学とは

1.1 計量経済学 (Econometrics) とは

- 目的 経済理論の計量化・数量化とそれによる経済理論の検証・検討
- 経済理論と経済モデル
 - ・ 経済理論 マクロ、ミクロ、金融、財政、国際貿易 etc.
例)マクロ：国民所得、消費、投資 etc.の因果関係など
 - ・ 経済モデル 経済理論の意味するところを数式モデルで表したもの
例) 日本酒需要 $Q \leftarrow$ 所得 Y 、日本酒価格 P_1 、洋酒価格 P_2
$$Q = f(Y, P_1, P_2) \quad (1.1)$$
$$\frac{\partial f}{\partial Y} > 0, \frac{\partial f}{\partial P_1} < 0, \frac{\partial f}{\partial P_2} > 0 \quad (1.2)$$
- モデルの定式化
$$Q = a + b_1 Y + b_2 P_1 + b_3 P_2 \quad (1.3)$$
 - ・ 符号条件 $b_1 > 0, \quad b_2 < 0, \quad b_3 > 0 \quad (1.4)$
 - ・ 相対価格モデル $Q = a' + b'_1 Y + b'_2 (P_1 / P_2) \quad b'_1 > 0, \quad b'_2 < 0$
 - ・ 対数線形モデル $Q = a'' + b''_1 \ln Y + b''_2 \ln (P_1 / P_2) \quad b''_1 > 0, \quad b''_2 < 0$
- 計量経済理論
 - ・ 分析手続 1 ①推定 (モデル(1.3)の b_i の値を計算)
②仮説検定 (推定値の有意性をチェック)
*これらは統計学の手法であるが、経済データには固有の問題が存在
 - ・ 計量経済理論 経済モデルや経済データ分析のための統計的手法
- 実証分析
 - ・ 分析手続 2 ③符号条件等、経済学的解釈
④構造分析、予測
 - ・ 計量経済モデル 受容されるべき理論を数量化したモデル
 - ・ 実証分析 応用計量経済学とも呼ばれ、上記の分析手続 2 を重視した研究
- 経済統計論 経済データ作成の方法等の研究分野

図 1.1-計量経済学の位置づけ

1.2 計量経済学発展の歴史

1.3 本書の構成