

同志社大学

2011年度 個人研究費研究経過・成果報告書

2012年4月3日提出

所 属	職 名	氏 名
経済学部	教授	佐竹 光彦
研 究 題 目	日本におけるフィッシャー仮説の検証	
研 究 成 果 の 概 要	<p>2000 年以来行ってきたフィッシャー仮説の検証において、構造変化を考慮した分析を展開してきた。2007 年度までに、1)フィッシャー仮説に関連する経済指標であるインフレ率と利子率の動きに構造変化があるかどうかを考慮すること、2)非線形モデルを適用して、フィッシャー仮説について 2 局面の異なる関係があること、以上 2 つの点に着目して分析を、継続的に行っている。</p> <p>しかしながら 1)については、変数個々の構造変化の分析しか行っていないので、変数間の関係が構造変化を起こしているかどうかを検討する共和分分析を行う必要がある。また、2)についても、2 局面の分析で、モデルが最も簡単な TAR モデルを採用しているなど、まだまだ検討する余地がある。そして、頑健な結果も得られていない。以上の 2 つの方向を発展させるため、2010 年度申請書類に示した<学術論文(単著)>4,5 の内容についてさらに厳密な検討を行い、フィッシャー仮説の成立に関する法則性を見出そうとしたが、新しい成果はまだ得られていない。</p> <p>なお、フィッシャー仮説の検証に関する研究がさらに進んでいることを受けて、2009 年度はそれらのサーベイを試みた結果、レビューの範囲が以外と広く、2010 年度にこの成果を学術論文として報告した。そのレビューの完成とともに、上にあげた 1)、2)に関する研究の一部をまとめて、オーストラリアのカーティン工科大学の PhD 論文として提出し、2011 年 11 月に学位を取得した。</p> <p><博士論文></p> <p>The Fisher Hypothesis: An Empirical Study with Application to the Japanese Economy, 2011 年 11 月. (PhD 論文 : Award Number 200739, Curtin University of Technology, Australia)</p>	