

よしむら ありひろ

吉村 有博

経済学部 助教
博士(経済学) /
京都産業大学・京都大学大学院

ホームページ URL
なし

主な研究業績

- Sueishi, N. and A. Yoshimura: Focused Information Criterion for Series Estimation in Partially Linear Models, *The Japanese Economic Review*, 2017, 68 (3), 352-363.
- Liu, Q., R. Okui and A. Yoshimura: Generalized Least Squares Model Averaging, *Econometric Reviews*, 2016, 35 (8-10), 1692-1752.

キーワード

計量経済学、因果推論、モデル選択

研究テーマ Research theme

マイクロ計量分析と因果推論のための モデル選択法の開発

概要 Overview

経済理論をデータから検証しようと考えるとき、経済変数間の因果関係を調べることは重要です。例えば、ある経済政策が賃金や経済成長率、貿易額などにどのような影響をもたらしたかを調べることは、大変興味深いテーマです。

因果関係を調べる際、まず考えられるのは実験でしょう。しかし、経済学は生物学や薬学などのように、実験室で原因や環境をコントロールしながら主体への影響を調べるような調査は、コスト面などから、まだまだ実施しにくいのが現状です。そのため、多くの分析では非実験データを用いる必要があります。

そのうえ、実経済では多様な情報と複雑な社会的・地理的關係の中で、人間が自由意志に基づき行動した結果としてデータが生み出されます。モノの価格や数量も、需要と供給の相互依存で決まります。つまり、実経済では興味ある原因変数をコントロールした下で、結果変数を観測するのはそもそも難しいのです。特に、原因と結果が逆方向きの因果を持つことや、原因と結果の双方に影響を与える第3の変数が存在する問題などが知られ、非実験データから因果の分析を行うには相応のアイデアが求められます。

このように、経済データとは大変複雑な過程を経て生成されたものと言えます。ここで、特に私が注目する問題は、データを生んだ「正しいモデル」を想定するのが難しい点です。多くの分析は「モデルに関する想定は全て正しいとする」ことを前提に進められます。しかし、もしこの想定が少なくとも一つでも間違っていた場合、結果は偏りを持つことが知られています。近年では、想定を間違えにくい方法や、間違えたとしてもうまくいく方法の研究が進展しましたが、この問題の根本的な解決は難しいとされています。

それでは、正しいモデルが分からない中でも、データから因果を偏りなく捉えることはできないのでしょうか。一つの考え方は、モデルの想定を間違えているかもしれないが、その中で相対的にマシなモデルを使うことができれば、意味のある分析ができるかもしれないということです。こうした研究領域をモデル選択といい、私の研究テーマの一つです。特に最近では因果だけではなく、予測への応用を見据えたモデル選択の研究にも注目しています。

応用分野 Application areas

本研究の主要な応用分野は、経済政策に関する因果関係の定量的評価を行う、政策評価です。また、汎用的な統計手法としても応用可能性も広く、例えばファイナンス、マーケティング、機械学習等においても有用であると考えられます。

共同研究等へのニーズ Need for joint research

共同研究のニーズは、ビッグデータを始めとする高次元データの解析などが考えられます。例えばある経済政策下における消費者行動に関するビッグデータが利用可能であれば、本研究で目指すモデル選択の方法と組み合わせることで、より詳細な因果関係の定量的評価が期待できます。

グリーンイノベーション

ライフイノベーション

情報通信技術

数物系科学

社会科学

人文学