

経済不平等度を予測するためのモデルについて

広島大学大学院社会科学研究所 西埜晴久*

日本経済における経済の不平等度の研究は、2000年代初めに橘木俊昭（1998）および大竹文雄（2005）において行われてきて、大きな関心を集めてきた。そこで、不平等度の時系列的な変動についても興味深い問題対象であると考えている。

本報告では、Nishino, H. and K. Kakamu (2011) で提案された対数正規分布を仮定して分位データを用いてモデル化する。なお、日本の家計調査のデータに対して対数正規分布は適合的である。そして、本報告ではそのモデルに GARCH 型の時系列モデルを組み込むことで、不平等度を予測するための時系列モデルを組み立てることを試みるものである。

参考文献

- [1] Nishino, H. and K. Kakamu (2011) “Grouped data estimation and testing of Gini coefficient using lognormal distributions,” *Sankhyā*, Series B, **73**(2), 193–210.
- [2] 大竹文雄 (2005) 『日本の不平等』, 日本経済新聞社.
- [3] 橘木俊昭 (1998) 『日本の経済格差』, 岩波新書.

*〒 739-8525 東広島市鏡山 1-2-1. Email: hnishino@hiroshima-u.ac.jp