

21世紀COEプログラム 平成15年度採択拠点事業結果報告書

|  |   |   |  |                   |                   |                     |
|--|---|---|--|-------------------|-------------------|---------------------|
| 機 関 名  | 一橋大学  | 学長名   | 杉山 武彦  | 拠点番号              | 110               |                     |
| 1. 申請分野  | F<医学系> G<数学、物理学、地球科学> H<機械、土木、建築、その他工学> <b>I&lt;社会科学&gt;</b> J<学際、複合、新領域>   |   |  |                   |                   |                     |
| 2. 拠点のプログラム名称<br>(英訳名)   | 社会科学の統計分析拠点構築<br>(Research Unit for Statistical Analysis in Social Sciences)  |   |  |                   |                   |                     |
| 研究分野及びキーワード  | <研究分野: 経済学>(統計調査)(人口統計)(計量経済学)(経済発展)(経済史)   |   |  |                   |                   |                     |
| 3. 専攻等名  | 経済研究所、経済学研究科応用経済専攻、経済学研究科経済理論・経済統計専攻、商学研究科市場・金融専攻、商学研究科会計・金融専攻、イノベーション研究センター  |   |  |                   |                   |                     |
| 4. 事業推進担当者   | 計 21 名  |   |  |                   |                   |                     |
| ふりがなくローマ字)<br>氏 名  | 所属部局(専攻等)・職名  | 現在の専門<br>学 位  | 役割分担<br>(事業実施期間中の拠点形成計画における分担事項)   |                   |                   |                     |
| (拠点リーダー)<br>Saito Osamu<br>斎藤 修<br>Aoki Reiko<br>青木 玲子<br>Kanbayashi Ryo<br>神林 竜<br>Asako Kazumi<br>浅子 和美<br>Abe Naohito<br>阿部 修人<br>Ohashi Isao<br>大橋 勇雄<br>Ogawa Eiji<br>小川 英治<br>Kanoh Satoru<br>加納 悟<br>Kitamura Yukinobu<br>北村 行伸<br>Kiyokawa Yukihiko<br>清川 雪彦<br>Kurosaki Takashi<br>黒崎 卓<br>Kurozumi Eiji<br>黒住 英司<br>Kuwana Youichi<br>桑名 陽一<br>Shiba Tsunemasa<br>斯波 恒正<br>Fukao Kyoji<br>深尾 京司<br>Matsui Hiroshi<br>松井 博<br>Motohashi Kazuyuki<br>元橋 一之<br>Iwaisako Tokuo<br>祝 迫 得夫<br>Yamaguchi Kouzou<br>山口 幸三<br>Yamanoto Taku<br>山本 拓<br>Watanabe Toshiaki<br>渡部 敏明 | 経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・准教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・准教授<br>経済学研究科(応用経済専攻)・教授<br>商学研究科(会計・金融専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済学研究科(経済理論・経済統計専攻)・准教授<br>経済学研究科(経済理論・経済統計専攻)・助教授<br>経済学研究科(経済理論・経済統計専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・助教授<br>イノベーション研究センター(経営確認研究分野)・助教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・准教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・准教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・准教授<br>経済学研究科(経済理論・経済統計専攻)・教授<br>経済研究所(比較経済・地域開発専攻)・教授 | 数量経済学、歴史人口学・経済学博士<br>産業組織論、応用ミクロ理論・Ph. D.<br>労働経済論、経済発展論・経済学博士<br>マクロ経済学、日本経済・Ph. D.<br>日本経済論、マクロ経済学、産業組織論・Ph. D.<br>労働経済学・経済学博士<br>国際金融論・商学博士<br>経済統計学、計量経済学・工学博士<br>応用計量経済学・D. Phil.<br>アジア経済論・経済学博士<br>開発経済学、農業経済学、アジア経済・Ph. D.<br>時系列解析、計量経済学・経済学博士<br>応用確立論、数理統計学、計量経済学・Ph. D.<br>計量経済学、計量ファイナンス・Ph. D.<br>国際経済学、マクロ経済学・経済学修士<br>統計調査論・工学士<br>産業組織論・商学博士<br>ファイナンス、マクロ経済学、アメリカ金融史・Ph. D.<br>統計調査論・工学士<br>計量経済学、時系列分析・Ph. D.<br>ファイナンス、マクロ計量分析・Ph. D. | 歴史統計・人口統計分析; データマイニング統括; 拠点リーダー兼拠点主任<br>ミクロ実証分析(平成17年3月31日交替)<br>ミクロ実証分析(平成17年4月1日交替)<br>マクロ実証分析<br>ミクロ実証分析<br>ミクロ実証分析<br>ミクロ実証分析<br>マクロ実証分析<br>経済統計分析; 拠点主任(平成19年8月15日辞退)<br>ミクロ実証分析; ミクロ分析研究グループリーダー<br>歴史統計・人口統計分析(平成18年3月31日交替)<br>ミクロ実証分析、歴史統計・人口統計分析<br>時系列モデルの研究(平成18年4月1日交替)<br>計量経済分析(平成18年4月1日交替)<br>計量経済分析<br>マクロ実証分析、歴史統計・人口統計分析; マクロ分析研究グループリーダー<br>経済統計分析(平成18年3月31日交替)<br>ミクロ実証分析(平成16年1月16日交替)<br>ミクロ実証分析(平成16年1月16日交替)<br>経済統計分析<br>計量経済分析; 統計理論研究グループリーダー<br>ファイナンス実証分析(平成18年4月1日交替) |                   |                   |                     |
| 5. 交付経費(単位:千円)千円未満は切り捨てる ( ):間接経費  |   |   |  |                   |                   |                     |
| 年 度(平成)  | 15  | 16  | 17   | 18                | 19                | 合 計                 |
| 交付金額(千円)   | 61,000  | 71,500  | 90,800   | 94,700<br>(9,470) | 98,000<br>(9,800) | 416,000<br>(19,270) |

## 6. 拠点形成の目的

「社会科学の総合大学」としての一橋大学には強い実証研究の伝統がある。社会科学のなかで経済学や人口学は、本質的に数量化された変数を扱う学問である。したがって、その学問の発展のためには、数量データをいっそう高い精度で整備・推計し、また数量データをより高度な方法によって分析することが要求される。本研究は以下の3つのコンセプトを結合させることにより、この課題に応えようとしている。

すなわち、データアーカイブと統計理論と、両者に支えられた高度実証研究とである。より具体的には、長期間をカバーする統計の整備とマイクロデータの高度利用を2本の柱として、データアーカイブを整備・拡充し、統計理論の研究と密接に連携しながら、日本やアジア諸国に関する、マクロ・マイクロ両面における歴史的およびカレントな課題についての実証研究を実施する。わが国の研究教育機関において、これら3つをすべて備えた研究拠点は、いまだ存在していない。その意味で本拠点は、わが国の社会科学系研究機関のなかで文字通りにユニークである。

社会科学における実証研究の意義は、自然科学における実験に比することができる。この意味における実証研究にとって重要なのが長期間をカバーする統計の整備と個票データの利用可能性である。本プロジェクトでは、政府統計を中心として、過去から現代までをカバーし、マクロとマイクロ双方の統計情報を蓄積してきている、経済研究所附属社会科学統計情報研究センターのアーカイブ構築の基礎の上に、統計理論の研究と密接に連携しながら、日本やアジア諸国に関する優れた実証研究を実施する。

本学の経済研究所には、日本の長期経済統計を編纂した経験と、歴史から現在を見とおすことのできる研究とデータの蓄積がある。本プロジェクトでは、この方向をアジアにまで拡張し、歴史統計の分析成果を取り入れつつ短期的な経済現象では説明できないような経済社会行動の理解を深める。現代の経済については、産業の生産性と経済成長の関連、景気循環にかんする基礎的な研究を実施する。他方、マイクロデータ分析セクションの開設は企業行動・労働市場に関する立入った分析が可能となった。家計の行動に関しては人口学的諸

要因との関連をも考慮にいれつつ、少子化社会における行動様式を解明する。

本プロジェクトのもう一つの柱は、これら様々な統計を利用する実証研究を統計理論の面から支える体制を創るところにある。すなわち、データベースの多面的活用を可能にするための基礎理論研究、データベース活用のための分析ツール開発、および個別データセットに応じた適切な手法の適用を研究し教育することである。加えて、他の研究分野との融合のプロトコールとなるべき基礎理論の構築も追求する。

本プロジェクトは、課題とする研究テーマの研究が終了したのちもわが国の実証的な統計分析の研究拠点となりうる体制が構築されるところに、他のプロジェクトにはない独自性がある。それゆえ、統計理論および実証研究両面における研究上の成果に加えて、本プロジェクトでは事業終了時まで

(1)『アジア長期経済統計』(全12巻予定)の刊行を開始する。

(2)マイクロデータ分析セクション独自集計シリーズの公表を行なう。

(3)各種データベースの作成。既存データベースに加え、内閣府経済社会研究所と協力して作られた日本産業生産性データベースの拡充、戦前期農家経済調査個票データベース化等の作業が行われる。

(4)確固たる統計理論のバックグラウンドを持ち、現実の経済社会を分析しうる博士取得者を輩出させる。

このデータ・アーカイブと人的資源を基盤とし、事業期間中に拡大するであろう国内および海外研究者とのネットワークを活かして、事業終了後も、他に例のない卓越した統計的実証研究の拠点形成、そこにおける「確実な知」の蓄積、そしてその基礎の上に様々な政策形成・制度設計上の含意を導くことが可能となる。

## 7. 研究実施計画

拠点形成は以下の4グループによって行なわれる

- (1) データ・アーカイブ
- (2) 統計理論研究グループ  
経済統計 計量経済分析
- (3) ミクロ分析研究グループ  
ミクロ実証分析
- (4) マクロ分析研究グループ  
マクロ実証分析 歴史統計・人口統計分析

右上の概念図のようにデータ・アーカイブを構築し、この基盤の上に経済分析と統計理論担当グループが協力しながら拠点を形成していく。各グループは以下の活動を行う。

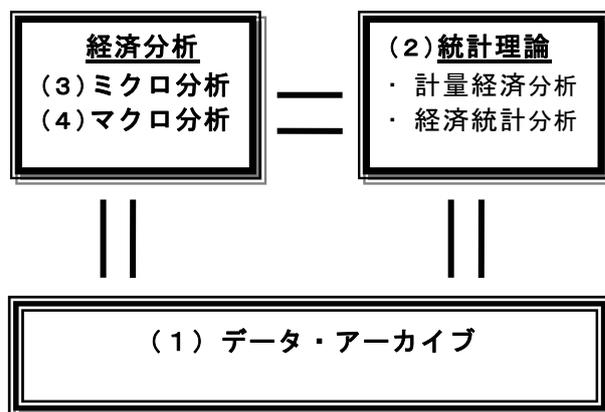
### (1) データ・アーカイブ

データ・アーカイブ機能は社会科学統計情報研究センターが担う。2002年度より社会科学統計情報研究センターに、官庁統計を中心としたミクロ統計分析セクションが新設され、ミクロ統計の公共的利用と、それら統計情報を用いた高度実証分析が可能になった。同センターでは、マクロ・歴史統計についても、すでにウェブ上で『日本長期経済統計』等のデータベースの公開を行っている。本事業では、『汎アジア圏長期経済統計データベース』の拡充を出発点として、景気判断のための統計、日本産業生産性データベース付帯表等の作成と公開を行い、歴史人口統計も収集・整理する。それらのうち、公開可能となったものからウェブ上にアップロードをしてゆく。

### (2) 統計理論研究グループ

データの収集とその一般利用のための理論分析を行なう経済統計グループと実証研究の理論的検討を行なう計量経済学グループからなり、データ・アーカイブと経済分析を繋ぐ役割を果たす。

経済統計グループは諸外国の統計機関との結びつきを重視し、欧州統計局や国連統計局、シンガポール統計局、カナダのセンサス局などから研究者を招き積極的にディスカッションを行なってゆく。平均年に一度国際シンポジウムおよび他グループと合同の国際シンポジウムを合計2回開く。計量経済学グループは、とくにデータ・アーカイブに蓄積されたデータの分析にとって有用なモデル分析の手法とその適切な応用について研究する。



### (3) ミクロ分析研究グループ

ミクロデータ分析は実証的な社会科学の最先端にあり、わが国でも飛躍的な発展が望める研究領域である。官庁統計を中心にミクロデータにより日本の企業行動・家計行動の分析を行う。ミクロデータは社会共有財産として公募による外部研究者の参加も促進する。また、海外の対応する研究機関との間でネットワークを構築する。

また官庁統計ミクロデータの独自集計(研究上意義があるが政府の統計報告書作成部局では作成しない統計表を、当該データの目的外使用申請を通じて集計するもの)を開始し、政府統計個票を利用した家計行動等の分析・研究を促進する。また、戦前期農家経済調査のデータベース化にも取り組む。

### (4) マクロ分析研究グループ

マクロ分析班では、『アジア長期経済統計』(東洋経済新報社より全12巻予定)の刊行をスタートさせ、日本産業生産性(JIP)データベースの整備・更新等を行い、現代経済における景気循環の分析などの研究を行う。

最初のアジア長期経済統計シリーズは、文部省中核拠点形成プロジェクト「汎アジア圏長期経済統計データベースの作成」(1995-99年度)を引継ぐもので、各班の作業を研究面で支援する。また成果の中核を経済研究所のウェブサイトを通じて国際的に発信し、収集されたデータを整理し、国際比較研究を行う。第2のJIPデータベースの拡充を基礎に、国際比較、グローバル化の影響の測定、IT投資の影響の測定等の視点から、日本の生産性停滞の原因、グローバル化やIT投資の影響に関する実証研究をも行なう。

## 8. 教育実施計画

拠点となる経済研究所の教員は、大学院経済学研究科においては比較経済・地域開発専攻に協力講座のかたちで参加し、大学院生の指導にあたっている。経済学研究科自体は、現在策定中の中期目標・中期計画において、学部・大学院の5年一貫教育プログラムを整備し、修士専修コースの新設・拡充を目指すこととしている。しかしこれは、研究者の養成を行う博士課程の教育を軽視することを意味しない。実際、博士後期課程に関する方針としては、他大学修士課程修了者、修士号取得済みの社会人の編入を積極的に行い、また修士専修プログラム修了者の博士後期課程への編入も可能とする体制をつくるのが合意されている。

このなかで、本プロジェクトのしめる役割は大きい。現在、経済分析の手法はますます高度化し、分析対象も拡大し、また利用可能なデータも増加してきた。これらの変化に対して、既存の大学院教育では十分に対応できていないという反省がなされている。

この実態を踏まえ、本プロジェクトでは、博士課程の大学院生およびポストドクトラル・フェローを対象に、データ解析のスキル、すなわち問題設定、分析手法、統計処理の仕方などに関しオンザ・ジョブ・トレーニングによって教育する。博士課程には、官庁あるいは民間の調査研究部門で働く、すでに修士号を有する、あるいはそれと同等の実力をもつ人材、また同様の資格と能力をもつ発展途上国等からの留学生を受入れ、彼らを教育し、博士号を授与することをも積極的に行いたい。

この教育プログラムのために、経済学研究科の比較経済・地域開発専攻にはすでに、経済研究所の教員が担当する「上級マクロ経済学」「応用マクロ経済学」「経済データ分析入門」「社会科学情報処理入門」「統計調査論」「比較統計システム論」「比較経済発展論」が設けられている。今後は必要に応じて、「特論」という講座種目を利用してプログラムを充実させてゆく。統計分析を中心とした実証研究で博士号を取得するためには統計技法の一定レベルのスキルが要求されるが、現在経済学研究科において実施されている「上級計量経済学」－「中級計

量経済学」の階梯に加えて、学部・大学院の5年一貫教育プログラムが実行に移されれば統計学に関する初歩から高度なレベルまでの、多様なバックグラウンドをもった編入者の多様なニーズに対応できることになる。

本プロジェクトは、大学院博士課程の教育面においても大学の内外から研究者を目指す大学院生を受入れることによって、日本の社会全体における統計分析の水準向上を目指し、社会科学における統計分析の総合的な教育拠点となることを目指すものである。

## 9. 研究教育拠点形成活動実績

### ① 目的の達成状況

#### 1) 世界最高水準の研究教育拠点形成計画全体の目的達成度

《目的は十分達成した》

研究面では、マクロ分析領域では、『アジア長期経済統計』の最初の巻が近々刊行され、他の3つの巻もとりまとめに入っている。JIPデータベースは最新版への更新を完成させ、それを利用した研究書をも刊行した。また、アジア通貨単位 (AMU) と AMU 乖離指標の作成を完成させ、景気循環の局面判断モデルの構築にも取り組んだ。ミクロ分析面では、独自集計を実施し、戦前期農家経済調査のデータベース化に積極的に取り組むと同時に、政府統計の個票を利用した家計行動等の実証分析を推進した。統計理論に関しては、実証分析との有機的連携を目指してパネルデータ分析や非定常時系列分析の計量理論に成果をあげた。

データアーカイブは Hi-Stat ウェブ上での公開を開始し、アジア長期経済統計推計作業の課程で作成された統計データの掲載を進めた。出版される統計系列の公開も適当なエンバゴ期間をおいて進める予定である。

また、本事業5年間の総括をするために外部評価を独自に実施、ミクロ分析分野では美添泰人 (青山学院大経済学部)、マクロ分野は Jan-Pieter Smits (オランダ・フローニンゲン大)、統計理論分野は Cheng Hsiao (南カリフォルニア大) の各教授にお願いをしたが、いずれの評価委員からも高い評価を得た。具体的には、「ミクロ統計データベース構築」は「学界に対する画期的な貢献」(美添)、一橋の歴史統計プロジェクトは “has become a major global player in this field” (Smits)、また統計理論グループと一部のミクロ分析班の研究については “The 2003-2007 research productivity and effectiveness of graduate program … are indeed impressive” (Hsiao) といわれており、目的を十分達成したことを裏付ける。

#### 2) 人材育成面での成果と拠点形成への寄与

この5年間にポスドク相当の COE 研究員を延50名 (各年度5名、9名、11名、13名、12名) と RA 相当の COE 学生アシスタントを延48名 (各年度13名、10名、11名、8名、6名) 雇用した。彼らは、101回を数える研究会やワークショップ (合宿形式の応用計量

経済学コンファレンスを含む)、9回のレクチャー・シリーズ (講師は雨宮健、Cheng Hsiao、E. Vytlačil 等) に参加をし、数多くの DP を執筆した。DP は (2008年3月末現在で) 250本になったが、その非常に多くが彼らと事業推進担当者のジョイント・ペーパーである (そして、その大部分が英語で書かれている)。彼ら自身の単独論文もあり、本事業でめざした OJT による育成の成果といえる。

その結果として、少なからぬ研究者が巣立ってゆき、たとえば東北大学、九州大学、広島大学、早稲田大学などの有力大学に就職あるいは就職予定となっている。

#### 3) 研究活動面での新たな分野の創成や、学術的知見等

##### ミクロ分析班

第1に、政府ミクロ統計の試行的提供を総務省統計局と連携して行った。具体的には平成19年10月時点で76件約100名の研究者に対して「就業構造基本調査」、「社会生活基本調査」、「全国消費実態調査」、「住宅・土地統計調査」などの政府統計の提供を行った。平成19年5月に改正された統計法の下で、さらにこの利用促進が求められるようになり、私たちの活動が「試行的提供」からより恒常化した提供へと変化していくことが期待されている。

第2に、戦前期の「農家経済調査」のデータベース構築を進めた。戦前期に同一農家に対してかなりの継続的期間にわたって、生産活動、消費、資産形成、時間利用など広範な項目にわたって調査しており、パネル化が可能なデータとなっていることに注目し、データベース化に取り組んだ。近いうちに約10県分の農家家計パネルデータが利用可能になるところまで進展をみた。

第3に、慶應義塾大と共同で「家計パネル調査」5回分の調査を行った。これは政府調査とは異なって、全国規模で各年齢層をカバーした包括的な調査であり、調査項目から自らデザインすることができるため、研究上多くの利点がある。このデータを使った研究はすでに活発に行われており、ミクロ分析班でも積極的に利用をして研究を行なった。

##### マクロ分析班

同班の活動は歴史統計グループとマクロ分析研究グループにわかれる。歴史統計分析の中心は、第1に、アジア長期経済統計の推計である。シリーズ第1巻「台湾」はすでに校了しており、近々東

洋経済新報社から刊行される予定である。また、ベトナム、韓国、中国の巻が取りまとめに入っていて、順次刊行の予定である。

第2に、その過程での資料収集、データの整備、一次結果に基づく分析、賃金率・一人当たりGDP・生産性の長期国際比較や戦前日本の所得・消費・労働の推計等を活発に行なった(ウェブ上にデータアーカイブを作成し、統計データの掲載を進めた)。また、フローニンゲン大、LSE、モンペリエ大、等の研究者と協力して、アジアだけでなく世界の他地域の長期統計もカバーするウェブページの作成を目指している。

第3に、マクロ分析研究グループの中心的事業として、経済産業研究所と共同で進めた、日本産業生産性(JIP)データベースの推計と分析がある。JIPデータベースは日本経済全体について108セクター別に、全要素生産性を推計するために必要な、総生産と中間投入、資産別資本ストックと資本コスト、属性別労働投入、などの年次データと、付帯表から構成されている。生産性の国際比較プロジェクトEU KLEMSに日本を代表して参加、内閣府、日本銀行、OECD、IMF、米国連銀等の研究でも利用され、公開データ最新版へのアクセス数は11,422件に達するなど、大きな貢献をしている。2008年3月には、この成果をまとめた研究書『生産性と日本の経済成長』(深尾京司・宮川努編、東大出版会)も出版された。

第4に、アジア通貨単位(AMU)と東アジア通貨のAMU乖離指標の作成と分析に取組み、景気循環の局面判断モデルの構築と景気循環の背景での経済主体の行動分析等をも推進した。

#### 統計理論班

班の研究活動は大きく3つテーマに分類できる。第1は、パネルデータ分析の計量理論である。統計理論と実証分析の融合という観点から、従来日本では殆どなされていなかった本格的研究を行なった。具体的には、基本的に定常な動学的パネルモデルの計量理論、具体的には既存の推定法のバイアスの修正、効率的な推定、系列相関検定などの開発に力が注がれた。この成果のとりまとめは、『経済研究』における特集「動学的パネル分析の計量理論」(2008年4月)でなされる。

第2は、非定常時系列分析の計量理論である。これも実証分析との関係を重視して研究が進められた。推定問題は、共和分回帰におけるバイアス

の小さい推定法の開発等、検定問題に関しては共和分モデルにおけるグレンジャーの因果性の検定の問題等が扱われた。予測問題に関しては、共和分モデルからの予測の改善方法、長期予測の評価等についての新しい知見が得られた。

第3に、上記の2テーマの他に、(a) 政府統計に関する統計理論、(b) 計量ファイナンス、特にオプション価格の計量分析、(c) 計量理論一般、例えば、マルコフ・スイッチング・モデル、不均一分散のベイス推定等についても研究が進められ、いくつかの重要な貢献がなされた。

#### 4) 事業推進担当者相互の有機的連携

事業の推進にあたっては各班の連携をよくするために、毎月幹事会をもち、各班の計画と活動、研究と大学院教育との調整をプロジェクト全体でチェックする体制をとった。

研究面では、統計理論と実証研究の融合を深め、マクロとミクロの垣根を取り払い、そして現在と歴史の往復ができる研究をしようということが本事業の意気込みであった。この目標はきわめて野心的なものであったが、5年をへて実を結びつつある。とくにミクロ分析班と統計理論班との連携は、統計理論班の研究課題の選択、2006年の応用計量コンファレンス、若手研究者向けのレクチャー・シリーズなどにおいて顕著で、特質に値する。また、マクロ分析の研究者がマイクロデータから積上げを図るタイプの研究も試みられ、それは歴史でも現代の研究でも行われるようになった。アジア長期経済統計の整備に携わっているひとが、戦前期日本の農家経済調査個票のパネル化に関わったり、1930年代の研究と現代的な研究課題との間を往き来したりすることも珍しくなくなった。これらは、研究面での有機的連携が機能していたことを物語る。

#### 5) 国際競争力ある大学づくりへの貢献度

本事業では年平均3回をこえる数の国際研究集会を開催し、海外の多くの研究者と交流を深めた。とくに2007年には、世界的な経済学者・経済史家のAngus Maddison教授に本学より名誉博士号が授与されるに際して、Hi-Stat Workshop Weekとして3つの異なったテーマに関する国際ワークショップを開催し、延168名の参加者があった。また、250本に達するDPからはReview of Income and Wealth, Review of Development Economics, Journal of

Time Series Analysis, Journal of the Japanese and International Economicsなど多数の査読付国際学術誌へ掲載された。

これら実績を踏まえ、前述の外部評価委員からは、歴史統計分野では本プロジェクトはすでに「グローバル・プレーヤー」であるとの、また統計理論とミクロ分析の領域における生産性と研究者養成の有効性は「印象的」との評価を得ており、一橋大学の国際的プレゼンスを高めるのに貢献をした。

#### 6) 国内外に向けた情報発信

##### データおよびデータベースの公開

アジア長期経済統計事業の一環として作成され、かつ出版社との契約上問題のないデータ系列に関しては、他の8つのデータベースとともにHi-Statのウェブ上で公開を始めており、国内外からの利用が可能となっている(<http://21coe.ier.hit-u.ac.jp/research/database/index.html>)。また、政府統計の独自集計シリーズは多くの研究者の利用に供されており、経済産業研究所と共同で公開をしているJIPデータベースとともに、統計を事業目的にしている本プロジェクトの重要な情報発信媒体となっている。

さらに、すべてのDPは本プロジェクトのウェブサイトで開催されているだけでなく、本学附属図書館のリポジトリ(Hermes-IR)にも登録をされており、アクセスによりいっそうの便宜を図っている。

##### 総合の書、上級教科書の出版

本プロジェクトの研究面での目的は高度実証研究を行なうことであって、決して啓蒙的な知識の提供を任務とはしていないが、本事業での研究成果に依拠した総合の試みや、上級レベルの教科書を通じた情報発信の努力はなされている。たとえば、斎藤修著『比較経済発展論』(岩波、2008年)は前者のタイプの書籍であり、北村行伸著『パネルデータ分析』(岩波、2005年)は後者のタイプである。後者ではさらに、千木良弘朗・早川和彦・山本拓著『動学的パネルデータモデル分析』(知泉書館)、北村行伸著『ミクロ計量経済学入門』、『応用ミクロ計量経済学』(共に日評)が予定されている。

#### 7) 拠点形成費等補助金の使途について(拠点形成のため効果的に使用されたか)

本事業は、社会科学における研究の進展にとっては「確実な知」の蓄積と公共財的な性格を有す

るデータの提供が欠かせないという信念にもとづき、統計データの整備関連の経費と、その整備に関わるリサーチ・アシスタントの雇用、および自由に研究を遂行する若手研究者の雇用、そして国際的な研究交流にたいして、重点的な予算配分を行なってきた。いいかえれば、学術コミュニティの外部に対するPR活動、たとえば啓蒙を目的とした講演会やグロッキーなニューズレターの刊行に資金を費やすようなことは一切行なわなかった。それゆえ、補助金は真の意味での中核的研究拠点づくりのために有効に使われたといえる。

#### ②今後の展望

データアーカイブ構築と統計理論の研究と高度実証分析とからなる研究拠点の礎は築かれた。

しかし、本プロジェクトで行なってきた事業の少なからぬものは、5年では終らせることのできない、学界の公共財的性格をもつ事業である。アジア長期経済統計シリーズの刊行、戦前期日本農家経済調査データベースの形成は、共にそのような事業である。必要なのは継続への強い意思とスキルの蓄積であるが、幸い時期を担う世代は育っている。財政的な支援があれば今後の展望は明るい。

#### ③その他(世界的な研究教育拠点の形成が学内外に与えた影響度)

- ・GDPや生活水準の国際比較研究で、日本がアジアにおける主導的役割を果たすようになった。真の意味での国際比較を行なうための方法論とデータの基礎が固まり、現代の産業レベルの生産性分析や歴史研究にひろがりをもたらされたと同時に、最近政府が行っている生産性加速プログラムにも実証的基礎を提供している。
- ・その結果、研究上の国際連繋が進んだ。EU KLEMSへの参加、LSE、フローニンゲン大との共同プロジェクト、またハーバード大、ウォーリック大との国際ワークショップの企画などが進んでいる。
- ・大学院に講座をもち、共同研究を通じて研究者をオン・ザ・ジョブで育成をし、既に有力大学に教員として供給している。さらに、JSPSの外国人フェローや海外の大学(UCLA、ソウル大等)からの派遣の形で院生やポスドクを受入れ、若手レベルでの国際交流をも進めた。

## 21世紀COEプログラム 平成15年度採択拠点事業結果報告書

|   |               |      |     |
|---|---------------|------|-----|
| 機 関 名   | 一橋大学          | 拠点番号 | 110 |
| 拠点のプログラム名称  | 社会科学の統計分析拠点構築 |      |     |
| <p>1. 研究活動実績</p> <p>①この拠点形成計画に関連した主な発表論文名・著書名【公表】</p> <p>・事業推進担当者（拠点リーダーを含む）が事業実施期間中に既に発表したこの拠点形成計画に関連した主な論文等〔著書、公刊論文、学術雑誌、その他当該プログラムにおいて公刊したもの〕</p> <p>・本拠点形成計画の成果で、ディスカッション・ペーパー、Web等の形式で公開されているものなど速報性のあるもの</p> <p>※著者名（全員）、論文名、著書名、学会誌名、巻(号)、最初と最後の頁、発表年（西暦）の順に記入</p> <p>波下線（<u>      </u>）：拠点からコピーが提出されている論文</p> <p>下線（<u>      </u>）：拠点を形成する専攻等に所属し、拠点の研究活動に参加している博士課程後期学生</p> <p>Abe, N., and S. Shimizutani, "Employment Policy and Corporate Governance: An Empirical Comparison of the Stakeholder and the Profit-maximization Model", <i>Journal of Comparative Economics</i>, 35(2), 2007, 346-368.</p> <p>浅子和美・原田信行「景況感とアンケート調査」『経済研究』55(2), 2004年, 171-184</p> <p>浅子和美・上田貴子・加納悟「政策と景気局面」, 浅子和美・福田慎一編『景気循環と景気予測』東京大学出版会, 2003年, 157-177</p> <p>深尾京司・宮川努・徳井丞次・乾友彦・浜潟純大「JIPデータベースによる成長会計分析」、深尾京司・宮川努編『生産性と日本の経済成長』東京大学出版会、2008年, 3-47.</p> <p><u>Fukao, K., Debin Ma and Tangjun Yuan, "Real GDP in Pre-War East Asia: A 1934-36 Benchmark Purchasing Power Parity Comparison with the U.S.", <i>Review of Income and Wealth</i>, 53(3), 2007, 503-537.</u></p> <p>Fukao, K. and Hyeog Ug Kwon, "Why Did Japan's TFP Growth Slow Down in the Lost Decade? An Empirical Analysis Based on Firm-Level Data of Manufacturing Firms", <i>Japanese Economic Review</i>, 57(2), 2006, 195-228.</p> <p>Ito, K. and Fukao, K., "Foreign Direct Investment and Trade in Japan", <i>Journal of the Japanese and International Economies</i>, 19(3), 2005, 415-455.</p> <p>祝迫得夫「1920年代のアメリカ経済の構造変化と大恐慌」『経済研究』57(3),2006年, 260-270.</p> <p>Iwaisako, Tokuo, "Corporate Investment and Restructuring," in Takatoshi Ito, Hugh Patrick, and David Weinstein eds. <i>Reviving Japan's Economy: Problems and Prescriptions</i>, MA: MIT Press, 2005.</p> <p>祝迫得夫・古市峰子「コーポレート・ガバナンスと会計問題」『経済研究』55(4), 2004年, 328-344.</p> <p>川口大司・神林龍・金榮慇・権赫旭・清水谷諭・深尾京司・牧野達治・横山泉「年功賃金は生産性と乖離しているか」『経済研究』58(1), 2007, 61-90.</p> <p>Kambayashi, R., "The Registration System and the Grade Wage: From cooperation to a market for human capital?," in Okazaki, T., ed., <i>Production Organizations in the Japanese Economic Development</i>, Routledge, 2007, 39-74.</p> <p>Genda, Y., H. Teruyama, S. Ohta, R. Kambayashi, and M. Ishihara, "Ageing and Employment in Japan", in Koichi Hamada and Hiromi Kato, eds, <i>Ageing and the Labor Market in Japan</i>, Edward Elgar, 2007, 1-23.</p> <p>Kitamura, Y., Chia Ngee-Choon and A.K.C. Tsui, "The Pension System in Japan and Retirement Needs of the Japanese Elderly", in <i>Ageing in Southeast and East Asia-Family, Social Protection and Policy Challenges</i>, ed. Lee Hock Guan, Institute of Southeast Asian Studies, Singapore, 2008.</p> <p>Kitamura, Y. and K. Sakamoto, "Marriage Behavior from the Perspective of Intergenerational Relationships", <i>The Japanese Economy</i>, 34(4), 2008, 76-122.</p> <p>北村行伸・坂本和靖「世代間関係から見た結婚行動」『経済研究』58(1), 2007年, 31-46.</p> <p>北村行伸 『パネルデータ分析』岩波書店,2005年</p> <p>北村行伸・坂本和靖「優雅な「パラサイトシングル」像が変容」『女性たちの平成不況』樋口美雄・太田清編, 日本経済新聞社, 2004年, 81-115</p> <p>不破信彦・伊藤成朗・久保研介・黒崎卓・澤田康幸「インド農村部における児童労働・就学と家計内資源配分」『経済研究』57(4),2006, 328-343.</p> <p>Kurosaki, T.. "The Measurement of Transient Poverty: Theory and Application to Pakistan". <i>Journal of Economic Inequality</i> 4(3), 2006, 325-345.</p> <p>Kurosaki, T.. "Consumption Vulnerability to Risk in Rural Pakistan," <i>Journal of Development Studies</i>, 42(1), 2006,</p> |               |      |     |

70-89.

- Kurosaki, T.**, and H. Khan. "Human Capital, Productivity, and Stratification in Rural Pakistan," *Review of Development Economics*, 10(1), February 2006, 116-134.
- Kurosaki, T.**, "Specialization and Diversification in Agricultural Transformation: The Case of West Punjab, 1903-1992," *American Journal of Agricultural Economics*. 85(2) May 2003, 372-386.
- Kurozumi, Eiji**, and Yoichi Arai, "Efficient Estimation and Inference in Cointegrating Regressions with Structural Change", *Journal of Time Series Analysis*, 28(4), 2007, 471-627.
- Ogawa, Eiji**, and Takeshi Kudo, "Asymmetric responses of East Asian currencies to the US dollar depreciation for reducing the US current account deficits", *Journal of Asian Economics*, 18(1), 2007, 175-194.
- Ogawa, Eiji**, and Junko Shimizu, "Stabilization of effective exchange rates under common currency basket systems", *Journal of the Japanese and International Economies*, 20(4), 2006, 590-611.
- Ogawa, Eiji**, and Junko Shimizu, "AMU Deviation Indicators for Coordinated Exchange Rate Policies in East Asia and their Relationships with Effective Exchange Rates", *The World Economy*, 29(12), 2006, 1691-1708.
- Ogawa, Eiji**, and K. Kawasaki, "What should the weights of the three major currencies be in a common currency basket in East Asia?" *Asian Economic Journal*, 20(1), 2006, 75-94.
- 大橋勇雄**「高齢者の雇用構造－事業所分析」『一橋経済学』2(1), 2007年, 25-29.
- 大橋勇雄**「高齢者は何を望んでいるのか」『一橋ビジネスレビュー』55(3), 2007年, 48-64.
- Ohashi, I.**, "Wages, Hours of Work and Job Satisfaction of the Ederly," *Japanese Economic Review* 56(2), 2005, 188-209.
- 斎藤修**「所得格差の動向」, **斎藤修**『比較経済発展論－歴史的アプローチ－』岩波書店, 2008年, 153-177
- Bassino, J.-P.**, **馬徳斌**, **斎藤修**「実質賃金の歴史的水準比較—中国・日本・南欧, 1700-1920 年」『経済研究』56(4), 2005年, 348-369.
- Saito, O.**, "Wages, inequality and pre-industrial growth in Japan, 1727-1894". in R. Allen et al., eds., *Living Standards in the Past: New Perspectives on Well-being in Asia and Europe*, Oxford U.P., 2005, 77-97.
- 斎藤修**「人口転換前の出生力とその上昇: アジアの視点から」, 法政大学比較経済研究所・尾高煌之助編『近現代アジア比較数量経済分析』法政大学出版局, 2004 年, 13-40.
- Chigira, H.**, and **Taku Yamamoto**, "Finite Sample Modification of the Granger Non-Causality Test in Cointegrated Vector Autoregressions", *Communications in Statistics, Theory and Methods*, vol. 36, 2007, 981-1003.
- Yamamoto, Taku**, and **Eiji Kurozumi**, "Tests for Long-Run Granger Non-Causality in Cointegrated Systems", *Journal of Time Series Analysis*, 27(5), 2006, 703-723.
- Kurozumi, Eiji**, and **Taku Yamamoto**, "Equivalence of Two Expressions of the Impact Matrix," *Econometric Theory*, 21, 2005, 870-875.
- Omori, Y.** and **T. Watanabe**, "Block Sampler and Posterior Mode Estimation for Asymmetric Stochastic Volatility Models," *Computational Statistics & Data Analysis*, 52(6), February 2008, 2892-2910.
- 渡部敏明**・**佐々木浩二**「ARCH 型モデルと"Realized Volatility"によるボラティリティ予測とバリュエーション・アット・リスク」日本銀行金融研究所『金融研究』第 25 巻別冊第 2 号, 2006 年, 39-74.

## ②国際会議等の開催状況【公表】

(事業実施期間中に開催した主な国際会議等の開催時期・場所、会議等の名称、参加人数(うち外国人参加者数)、主な招待講演者(3名程度))

2004年5月13日 於 国際交流基金コンファレンスホール

Macro/Financial Issues and International Economic Relations 参加人数60名(うち外国人14名)

主な招待講演者: Robert Stern (University of Wisconsin), Ronald I. McKinnon (Stanford University), Gary Saxonhouse (University of Wisconsin)

2004年12月18-19日 於 一橋大学マーキュリータワー

Hitotsubashi Conference on Econometric Statistics 参加人数32名(うち外国人4名)

主な招待講演者: 雨宮健 (Stanford University), Roberto S. Mariano (Singapore Management University), Mike P. K. So (Hong Kong University of Science and Technology)

2005年9月8-9日 於 一橋大学佐野書院

Technology and Long-run Economic Growth in Asia 参加人数42名(うち外国人17名)

主な招待講演者: Jan Thomas Lindblad (University of Leiden), Prema-Chandra Athukorala (Australian National University), Hak Kil Pyo (Seoul National University)

2006年1月7-8日 於 一橋大学マーキュリータワー

Hitotsubashi Conference on Econometric Statistics 参加人数35名(うち外国人4名)

主な招待講演者: 霍見浩喜 (Rutgers University), Chan-Jin Kim (Korea University), Myoung-Jae Lee (Chinese University of Hong Kong)

2006年7月24-25日 於 経済産業研究所

Industry- and Firm-level Total Factor Productivity and Economic Growth in Japan

参加人数42名(うち外国人10名)

主な招待講演者: Dale Jorgenson (Harvard University), Marcel P. Timmer (University of Groningen), Hak Kil Pyo (Seoul National University)

2006年9月23-24日 於 東京大学経済学研究棟

Recent Advances in Applied Econometrics 参加者数48名(うち外国人5名)

主な招待者: Andrew C. Harvey (Cambridge University), Herman van Dyck (Erasmus University Rotterdam), Cosras Meghir (University College London)

2007年3月19-20日 於 一橋大学商学研究科丸の内産学連携センター

International Workshop on Consumption 参加人数 15名(うち外国人6名)

主な招待講演者: Richard Blundell (University College London), Orazio Attanasio (University College London), Kjetil Storesletten (University of Oslo)

2007年9月26日 於 一橋大学佐野書院

Hi-Stat Workshop Week: (I) Historical Comparison of International Income and Productivity

参加人数35名(うち外国人14名)

主な招待講演者: Steve Broadberry (University of Warwick), Thomas Rawski (University of Pittsburgh), Jan Peter Smits (University of Groningen)

2007年9月27日 於 一橋大学佐野書院

Hi-Stat Workshop Week: (II) China's Industrial Structure and Economic Growth: A Historical Perspective

参加人数75名(うち外国人36名)

主な招待講演者: Angus Maddison (University of Groningen), Harry Wu (Hong Kong Polytechnic University), Li Shi (Beijing Normal University)

2007年9月28日 於 一橋大学佐野書院

Hi-Stat Workshop Week: (III) Historical Occupational Structures: Asian and European Perspectives

参加人数51名(うち外国人25名)

主な招待講演者: Erick Buyst (University of Leuven), Leigh Shaw-Taylor (University of Cambridge), Daan Marks (International Institute of Social History, Amsterdam)

2007年11月24-25日 於 一橋大学マーキュリータワー

Hitotsubashi Conference on Econometrics

参加人数45名(うち外国人6名)

主な招待講演者: Cheng Hsiao (University of Southern California), Kaddour Hadri (Durham University), In Choi (Hong Kong University of Science and Technology)

## 2. 教育活動実績【公表】

博士課程等若手研究者の人材育成プログラムなど特色ある教育取組等についての、各取組の対象（選抜するものであればその方法を含む）、実施時期、具体的内容

### ・大学院経済学研究科および商学研究科での教育とリサーチ・アシスタント(RA)

経済学研究科および商学研究科の教員はそれぞれの研究科において、また拠点である経済研究所所属の教員は、協力講座という形態で比較経済・地域開発専攻を設け、これまでも積極的に大学院教育に携わってきた。ただ、拠点メンバーが指導する院生はこの専攻にとどまることはなく、副指導教授としての指導（いわゆるサブゼミでの指導）を含め、ひろく他専攻の院生にまで及んでいる。これら複数の専攻におよぶ院生のなかから本事業は、拠点メンバーとの共同研究あるいは個人研究を遂行する研究者をRA(正式名称はCOE学生アシスタント)として、公募により雇用した。2003年度は13名、2004年度10名、2005年度11名、2006年度8名、2007年度6名であった。共同研究はOJTの場である。それによって、単なる統計分析テクニックの伝授から、調査票設計、個票データのクリーニングから集計された政府統計の読み方まで、データの扱い方にかんするトレーニングが行われたが、平成18年(2006)度からは経済学研究科にリサーチワークショップ「社会科学の統計分析」を開講し、大学院カリキュラムの一環とした。

### ・COE研究員

本事業では、拠点メンバーとの共同研究あるいは個人研究を遂行する、原則として博士課程単位取得者以上レベルの研究者をCOE研究員として、公募により受入れた。彼らは本事業の中核をなす研究者であり、データベースの作成や拠点メンバーとの共同研究、さらには独自の研究テーマによる個人研究を遂行した。2003年度は5名、2004年度9名、2005年度11名、2006年度13名、2007年度12名が在籍をした。この他に、予算措置を伴わないという意味で正規のメンバーではないが、若手の訪問研究者を受入れた。在籍期間も身分も所属機関もさまざまであるが、半数が外国の博士課程院生ないしは博士論文執筆者、半数がポスドクないしは講師クラスの若手研究者で、研究上のさまざまな便宜供与と研究交流が主な内容であった。

### ・レクチャー・シリーズ

本事業では院生・RA・COE研究員等の若手研究者を対象とした、しかし正規のカリキュラム外のそれぞれ2-4日の講義形式によるレクチャー・シリーズを開催した。統計理論班とマイクロ分析班とが中心となり、5年間で計9回実施をしたが、講師は大学院生、他大学の若手研究者から世界的に知られた大家までと、さまざまであったが、通常の講義形式の授業ではえられない、しかし最先端の知識と、それをリサーチに活かすためのアイデアを院生・若手研究者に伝授することが目的という点では共通をしていた。日時、講師、テーマは以下のとおりである。

第1回2004年2月19-20日 片山直也(一橋大学大学院)「長期記憶時系列分析について」

第2回2004年3月8-9日 Cheng Hsiao (University of Southern California) “Dynamic Panel Data Models”

第3回2004年4月16, 30日, 5月14, 21日 川口大司(当時は筑波大学)「パネルデータの実証分析」

第4回2004年11月29日, 12月6, 13, 20日 山内太(当時は政策研究大学院大学) “Modeling and Testing Informational Learning: Human Capital and Technology”

第5回2006年1月10-11日 霍見浩喜(Rutgers University) “Recent Developments in Bayesian Econometrics”

第6回2006年2月13, 16日 上田貴子(早稲田大学)「動学モデルと数値計算」

第7回2006年3月14, 15日 In Choi (Hong Kong University of Science and Technology) “Non-stationary Panel Data Models”

第8回2006年5月9, 16, 23日 雨宮健(Stanford University) “Qualitative Response Models, Tobit Models, Duration Models”

第9回2007年7月3, 5, 6日 Edward Vytlacil (Columbia University) “The Microeconometrics of Treatment and Policy Evaluation”

これらはいずれも、院生・若手研究者に好評で、彼らの研究の進展に資すること大であった。

21世紀COEプログラム委員会における事後評価結果

(総括評価)

設定された目的は十分達成された

(コメント)

アジア長期経済統計の作成にかかわる本プロジェクトが、学界にとって公共財としての大きな役割を果たしていることは、中間評価でも高く評価されており、そこで指摘したデータの公開性についても、ウェブでの公開など大きな進捗が見受けられ、経済分野の実証的研究の拠点として本拠点が果たしてきた役割は大きく、事業期間中においても十分な成果をあげたと評価される。

人材育成面については、大学院生及びポスドクに相当の経済的支援が行われたほか、研究会やワークショップへの参加者が増加し、執筆者として参加するディスカッション・ペーパーが多数刊行されている。しかし、中間評価で指摘された課程博士授与数の増加については事業後半で増加しているものの、必ずしも十分達せられたとは言い難い。また、博士後期課程の学生数は定員割れの状態が続き、大学院の教育課程で大幅な改革が行われたようには見受けられない。しかし、全般的には、本拠点の持続可能性は保証されているとしてよい。

研究活動面については、『アジア長期経済統計』の刊行が開始されたほかに、計画されたマクロ、ミクロのデータベース構築が着実に進んでいる。また、関連する分析、研究も研究論文として結実し、実績面についても、量的な面だけでなく、質的な水準も高く、内外への情報発信も十分に行われている。本拠点については、公共財的性格のある事業の継続を最大のアウトプットと見なすべきであり、その意味では、十分な成果をあげていると評価できる。

事業終了後については、本拠点はデータベースの構築という点で伝統と実績のある組織であり、持続的展開が期待できる。