

1870年代から1920年代にかけての Jevons や Moore 等による景気循環分析に発端があったとして、筆者は解説を試みている。

Jevons の景気循環分析は、黒点の発生周期に起因して起こる気候の変化が穀物の収穫そして価格の変動に影響を与え、その結果として景気の変動に影響を与えるはずであるという仮説から始まった。しかし黒点の発生周期の 11.1 年と景気変動の周期との間に明確な整合性がないことから、この原因が社会的、政治的、経済的要因によるとして分析を始めたのが景気循環分析の始まりであるとしている。この分析の過程を彼の論文の一部を引用しながら体系的にまとめ上げている。

Moore の分析は Jevons の仮説とは違って、経済変動は気候が外的要因として影響するとして、1839 年から 1910 年までのオハイオ地域の降雨量の分析から始めた。この分析の結果 8 年周期と 33 年周期が重なった変動をしていることを発見した。さらに同じ分析を 1870 年から 1910 年までイリノイについて行い、穀物の成長がこの降雨量に関係していることを見つけた。この発見過程を、Jevons の場合と同様に彼の論文の一部を引用しながら、どのようにしてこの周期を発見したかを説明している。

1920 年代から 1930 年代にかけては Juglar, Mitchell, Persons 等が Jevons や Moore とは違った統計的手法で、景気循環を分析している。これらについても Juglar の理論、Mitchell の理論そして Persons の理論について、各々の論文もしくは著書の一部を引用しながら、どのようにして彼らが理論を組み立てていったか、そして何が問題であったかを説明している。またこの年代は各国で景気循環を分析するための研究所が設立された時代でもあった。これらの研究所の主な活動についても言及されている。この時代はまた、まだ計量経済学という分野が生まれたというよりは経済統計学とか数量化経済学と呼ばれていた時代でもあった。

そしてこれらの理論を組み立てていく上で、景気循環に影響を及ぼす不規則的衝撃の研究が Yule, Slutsky そして Frisch 等によって行われ、さらには、もっと動的に分析しなければ、景気循環を分析することができなるとし、Tinbergen 等のダイナミックモデルに引き継がれていく過程を彼らの論文や著書を引用しながら説明を試みている。

第 2 部では、景気循環分析とは別に、計量経済学の成立に影響したもう 1 つの分析手法である需要分

メリー・S・モーガン

### 『計量経済学の歴史』

Mary S. Morgan, *The History of Econometric Ideas*, Cambridge: Cambridge University Press, 1990, xv+296 pp.

本書は、計量経済学が如何にして成立したかを体系的に整理した著書である。筆者によると、計量経済学は、一般に 1950 年代以降に成立した学問であると考えられてきているが、しかしその発端は 1950 年以前の景気循環分析、そして需要分析にあるとして計量経済学の成立過程の分析を試みている。筆者は、これらの 2 つの分析手法がどのようにして成立し、そしてどのようにして発展してきたかを、その各々の分野で発表された論文や著書の一部を引用して説明を試みている。そして最後に、経済現象を計量経済学的に定式化 (Formal Model) する過程で、どのようにして理論を組み立てていったかを往復書簡の形を用いることによって数学的記述を最小限度にして見事に説明している。以下各々の章について見てみることにする。

第一部では、計量経済学の成立する根本の 1 つに

析について詳しく述べている。つまり需要分析を行う上で統計的なデータの収集方法の確立と、その分析手法の発達が計量経済学に及ぼした影響について述べられている。

需要関数の計測は1699年のDavenant(一般にはKing則として知られている方法)に始まるが、数学的な記述で表現されるようになったのは、19世紀末期からである。20世紀に入ると統計的手法を用いて各種のデータを分析する方法が定着するようになり、この1つの応用にハーバード景気予報がある。

またこの時代は、BeniniやGini等によってWalrasianとMarshallianモデルを、回帰分析によって表現しようとした時代でもあった。

さらに需要分析を進めていく過程で、単一回帰式で表現することが困難となり、Tinbergen等のダイナミックモデルに引き継がれていく過程や、需要供給モデルでよく用いられる恒等式の問題についても第1部と同様彼らの論文や著書を引用しながら歴史的な背景を含めて説明を試みている。

第3部では、第1部、第2部で述べられた統計データと経済理論を如何にして結び付けてきたかを架空の往復書簡の形を借りてその理論を如何にして検証してきたかを説明している。計量経済学者が彼らのアイデアを経済学の原理と経済データを用いて実現したかをデータに誤差がある場合と、モデルに誤差がある場合とに分けて、経済学的意味を踏まえな

があまり数式を用いることなく説明を試みている。

最後にHaavelmoの確率モデルについても、そのモデルが作られるに至った経緯を、Koopmansの著書の一部を引用することによって解説を試みている。

全般的にあって、本書は、計量経済学が1つの学問分野として成立する以前の歴史について、計量経済学が学問分野として成長するに多大な影響を与えた理論経済学的事項として景気循環分析そして需要分析に注目して解説を試みた著書といえる。この解説のなかで、できるだけ数学的記述を避けるように配慮されており、計量経済学が成立するに至った経緯について体系的に非常に良く整理された書物と言える。しかし、1950年代後半から計量経済学は、マクロモデルの時代に入っていく、さらに計量経済学の分野が細分化していく時代でもあった。このためこれらの記述について、続刊ができることを期待するものである。

とはいえ、マクロモデルをこれから学ぼうとする上で、必要になる計量経済学の基礎的な事柄が、必要最小限度の数学的記述を用いて記述されており、また計量経済学に関する参考文献も体系的に整理されており、これから計量経済学を学ぼうとする諸氏には、一読の価値のある書物であるといえる。

[安田 聖]