

ラムゼイ型最適資本蓄積モデルの効用関数の逆算手法について

細矢 祐誉*

Graduate School of Economics, Keio University

概要

本稿の目的は、Ramsey-Cass-Koopmans の最適成長モデルにおいて、生産関数と政策関数から割引率と効用関数を逆算する方法を提供することである。この方法を構築することの目的は、推定が比較的容易であろうと思われる生産関数や政策関数から効用関数を計算する技術を確立することによって、効用関数の推定難易度を下げることにある。この点で本稿は消費者理論における積分可能性理論をマクロモデルに応用したものと見ることができる。本稿では計算方法に加えて一意性も証明するが、時間加法的な形にこだわっているため、その一意性は正アフィン変換を除いての一意性となっている。

JEL codes: D11, C61, E13, O41

Keywords: Ramsey-Cass-Koopmans model, dynamic programming, utility function, infinite product.

* E-mail: stairlimit(at)moon.cims.jp