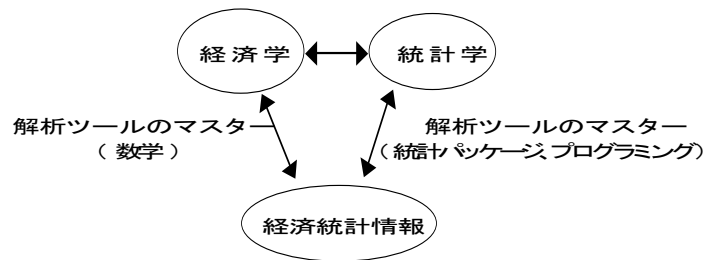


第 1 講 概 説

1.1 統計情報の意味・位置づけ



利用者 経済分析をする上での材料としての経済情報、道具としての統計学。

統計作成者 経済情報を集めて、統計として作成する上での分析枠組み、概念規範としての経済学、標本理論等の道具としての統計学。

経済学を専攻して実証分析をしてみたいと思う人にとっては、経済学の基礎知識（マクロ、ミクロ経済学）、統計学の基礎知識（確率論、回帰分析、検定、時系列、クロスセクション分析、パネル分析）、経済統計情報（データの所存（有無）利用可能性、データの性質、調査票の内容、データの限界）を最低限度身につけておく必要がある。

実際には、経済学の分業化が進んで、それぞれをマスターするのにかなりの労力が必要とされることから、全体をバランスよく学んでいる人は少ない。しかし、少なくともいわゆるエコノミストとして大学、企業シンクタンク、官庁、中央銀行、国際機関等で仕事がしたいのであれば、このバランスは必要である。とくに統計学の知識は道具として有用なので、この際、努力して身につけておくことをおすすめする。

統計学を実践的に身につけるためには、実際のデータを使って、統計分析をする以外にはない。教科書を何回読んでも実感はわからないが、データを分析しているうちにわかっていくことがある。

日本銀行の調査統計局あるいは金融研究所では、新入りの学卒、院卒者を少し年次の上のものが徹底して鍛えて、まともな実証ができるようにする。この場合、場当たりの千本ノック（リグレーション1千回）に基づく実証ははなはだ時間のロスになるだけでなく、経済学のセンスを磨く上でも障害になる。

どうすれば無駄な実証をしなくてすむか？

1. 適切な経済理論に基づく

この適切さは逆にデータをじっくりと観察することによってわかる（理論とデータのフィードバック）

1ヶ月ぐらいデータを眺める → 理論モデルを作る

2. 適切な経済統計データを用いる

理論で証明したいこととデータの間ギャップがあると証明にならない。

3. 適切な統計手法を用いる

データの性質をよく理解した上で適切な推計方法を選ぶ

モデルはできるだけ一般的な形式のものからスタートして、徐々に特殊化する（General to specific approach, David Hendry (Oxford University) の計量経済学手法）

ここでとりわけ重要なのは、適切な理論の選択である。ここに一番時間を割く必要がある。

よくある間違いは、適切な経済理論に基づかないために、曖昧な直感によって、関係のありそうな変数をとにかく回帰モデルに放り込んでしまうことである。その場合、ストックとフローのデータ、次元の違うデータ（単位根検定によってわかる $I(1)$ 、 $I(0)$ 等）が混在していたりするが、それはほとんど常に経済理論に基づかない回帰を行っている結果である。

1.2 経済問題の2大焦点

因果関係

理論なくしては因果関係はわからない。統計的な因果テストは物理的な因果関係を示しているわけではない。

比較検討

- A国とB国の特定の経済変動のパフォーマンス（GDP成長率、インフレ）を比較して、その違いの原因を探る（クロスカントリー分析）
- A年とB年を比べてそのパフォーマンスを評価する（時系列分析）
- A国とB国の社会経済制度全体を比較して、そこから国別のパフォーマンスの違いを説明する（比較制度分析）
- A国とB国の共通の経済発展のパターンを描出して、そこから経済発展論を導く（ガーシェンクロン <Gerschenkron>、ロストウ <Rostow> … 比較経済史）
- 政策Aの下での経済攻勢と政策Bの下での経済攻勢を比べて、政策評価する（比較効用分析 … 新厚生経済学）
- A … Z国のマクロ経済時系列データを集めて、比較可能な形で整理する（OECD、IMF、国連データベース … Penn World Table）