経済「統計」の通信簿

東京大学経済学研究科
経済学部教授　西 村 清 彦

1984年にロンドン・エコノミスト誌が，今後10年間の経済の予想をイギリスの４つのグループの４人に聞いたことがある。その内訳は，４人の元大蔵大臣，４人の企業経営者，４人のオックスフォード大学の学生，そして４人の煙突掃除人だった。聞いた内容は，今後10年間の平均の経済成長率，平均インフレ率，原油価格，そしてシンガポールのＧＤＰがいつオーストリアを抜くかである。

10年後その結果をみると，なんと元大蔵大臣グループの予想が一番外れていたそうである。そして企業経営者グループの予想も煙突掃除人グループとたいして変わらないという結果であった。同誌は，この結果を見て，これからの10年を予測するには，高いコンサルタント料を払わなければいけない元大蔵大臣や，企業経営者に聞くよりも，煙突掃除人に聞けば，安くて結果も変わらないと皮肉っている。

こうした長期の経済変動にまつわる統計・予測の信頼性については，パーティージョークの良い話題であるが，長期経済変動の分析を生業とする経済学者の一部を除いて，あまり実害はなさそうである。しかしこれが短期の，しかも直近の経済統計の信頼性となると，きな臭くなる。

2000年５月11日，経済企画庁（当時）は1999年10月～12月期ＧＤＰの二次速報値を対前期比－1.4％の成長率であると公表した。その際，金融機関の設備投資額を事前に公表されていた統計作成ルールに基づいて「実績値」で推計するのではなく，一次速報時に用いた「実績見込値」を利用していたが，それについての積極的な説明がなかった。そもそもこの情報は公表情報からすぐに分かる情報であり，企画庁側からその理由についての説明がなされなかったことがその後の大きな波紋を呼ぶことになったのである。

５月24日付けのニューヨークタイムズ紙は，こうした統計作成方法の問題を取り上げ日本のＧＤＰ統計の信頼性に対して疑問を呈した。ニューヨークタイムズは，これには政治的な意図があり，「日本政府は，政治的な理由から，ＧＤＰ統計について，重要な情報を織り込まなかった」と主張し，こうしたために「日本の公表経済統計は，常に信頼が置けなかった」とまで断罪した。この報道は逆に日本側にフィードバックされて，日本側マスコミに大きく取り上げられ, 政治問題化した。

この報道の直後，経済企画庁では，上記「実績値」の精査を終えたとして，「実績値」を用いた「二次速報改定値」を公表，前回の公表値を下方修正した。つまり2000年５月25日に，対前期比－1.6％であると修正したのである。

経済統計とそれを使った予測の信頼性に疑問が

あるという批判は，日本についてだけではない。ニューヨークタイムズ紙のお膝元の米国では，既にロンドン・エコノミスト誌のアンケート調査の時期の米国大統領レーガンが，経済統計に基づくエコノミストの予想がはずれるのに業を煮やして，政権にエコノミストはいらないと公言したことは有名である。

統計データには記入間違い等のエラーがあり，「異常値」が存在する可能性がある。しかし異常値はこうした誤りではなく真の変化を示すときもある。今回の企画庁のケースは異常値について通例のやり方で「慎重」に対処したところが，実は異常値ではなかったことがわかって修正したというのが真相のようである。しかしこの統計「数字」に基づいて政策評価がされ，特に最近の低成長期でコンマ何％（つまり小数点以下の数字）が問題となるような風潮で，この「統計の改定」は大きく政治問題化した。

そもそも経済統計は大抵のものは「推計」でありその推計には大きな誤差があるという単純な事実が，政治家マスコミのレベルではよく理解されていない。しかも，上の事実から分かるように，政治家マスコミは，日本発の情報発信よりも，外国発の情報発信に遥かに敏感である。そもそもニューヨークタイムズが問題にした内容は，日本のＧＤＰウォッチャーにとっては周知の事実のはずだったのであるが，その誤差は，最新のデータを要求すればするほど大きくなる。信頼のおけるデータほど，利用可能になるのが遅れるので，すぐに推計しなければならないときは，信頼度の落ちる代用品で済まさなければならないのである。必要なのは「推計」としての経済統計に必ずつきまとう「誤差」を正しく理解しそれを減らす方策をとること，更に政策運営上特定のデータに過度に依拠することを避けることである。

たしかに，最近国内，国外を問わず日本の経済「統計」の通信簿の中身は，誇れるものではないようである。とはいえ，そんなに役立たずなら，経済統計はいらないということになるかというと，どうもそうではない。世界で「市場化」が進むにつれ，経済統計への需要は高まりこそすれ，減少はしていない。

一見矛盾するようだが，そうではない。経済統計が本当に必要とされている分野は，実は成長率や株価といった将来の表面的な予測ではない。現在から将来への経済の大きな流れをとらえる「論理」，表面にはでない底流の変化を明らかにすることである。「変化」を見つけるための「カメラ」を提供することなのである。市場化が進み市場の動きが速ければ速いほど，それにふさわしい解像度のレンズとシャッタースピードをもったカメラへの需要が高まる。

ちょうど学校の通信簿が生徒の能力を表面的にしかみれないように，経済「統計」の通信簿も，真の能力を示すものではない。表面的なあたりはずれではなく，経済の流れの「論理」を骨太に取り出すことができる素材としての能力が経済「統計」の真の能力なのである。

㈶全国統計協会連合会

「統計情報」2001，5月号より