

# CPIに関する取組 2005～06（最終回）

## － IMFにおける国際基準・規範の遵守状況に関する報告書(ROSC)について －

清水 誠・永井 恵子

本稿では、消費者物価指数を巡る最近の議論・取組について連載している。

これまでは特定のトピックごとにCPIの話題を取り上げてきたが、連載の最終回である4回目は、CPI全般に渡る国際的な評価に関する話題として、先般IMFが日本に対して行った国際基準・規範状況に関する評価報告書(ROSC)について紹介する。

### 1 ROSC (Report on the Observance of Standards and Codes) とは

1990年代のメキシコ金融危機やアジア通貨危機を背景に、IMFにおいて、国際金融危機を予防する観点から、世界経済の効果的な調査・監視及び潜在的な問題の把握が議論され、今後の世界的な金融危機を予防するためのプログラム(ROSC)の作成が提唱された。

ROSCには①データの透明性、②金融・財政政策の透明性、③会計の透明性、④銀行行政(監視・管理)、⑤安全保障、⑥保険、⑦決済体系(貸金体系)、⑧マネーロンダリング(不正金融)の対処、⑨コーポレートガバナンス(企業統治機構)、⑩勘定体系、⑪会計監査、⑫債務超過と債権の12の分野があるが、このうち①のデータの透明性に関するものがデータモジュールROSC(データROSC)と呼ばれるものである。

データROSCは、IMF特別データ公表基準

(SDDS)に照らし、各国のデータ公表慣行の概要を評価するとともにIMFデータ品質評価フレームワーク(DQAF)に基づく6つの主要マクロデータセットに対する品質評価を行うものである。この6つの主要マクロデータセットは、国民経済計算、消費者物価指数、生産者物価指数、政府財政統計、金融統計及び国際収支統計である。

このデータROSCのための審査の受入れ及び審査結果の公表については各国の任意となっているが、これまでフランス、イタリア、カナダ、スウェーデン、韓国、ドイツなどについての結果が公表されている。

2006年3月に公表された日本のデータROSCについては、2003年11月にIMF統計局から日本に対してミッション受け入れが打診された。その後、統計作成部局による事前の自己診断書の提出、IMFの求めに応じた各統計のユーザーに対するアンケート調査の実施及びその回答提出を経て、IMF統計局は2005年9月12～28日に対日ミッションを実施した。このミッションではIMF統計局から専門家で構成されたミッションチームが来日し、3回の全体会合に加え、それぞれのデータセットについて、詳細な情報の聴取及び意見交換が行われた。また、この間各統計のユーザーとの会合も開催された。なお、ミッションチームの物価統計の担当はMick Silver氏であった。

IMF統計局は、一般に公開されている情報、対

日ミッションでの統計作成部局からの提出情報、ユーザーに対するアンケート調査結果等から評価報告書の暫定版を作成した。その後、この暫定版について日本の統計作成部局と何度か協議し、報告書の確定版を作成した。さらに、評価報告書に対する日本の統計作成部局からの回答を取り寄せ、日本の同意の下、2006年3月にこの回答を併せた評価報告書を公表した。

## 2 ROSCにおける評価基準

IMFは、各国のデータ品質を国際比較・評価するための具体的かつ詳細な基準としてDQAF(Data Quality Assessment Framework)を策定し、これをデータROSCにおける評価手法として組み込んでいる。

DQAFはデータの収集、処理及び普及・公表の様々な品質側面を包括的に網羅しており、次元、要素、指標という3つの段階式構造から成っている。第一のレベル(次元)は、品質の要件に加え、品質の5つの側面、すなわち規範性の保証、方法の健全性、正確性・信頼性、実用性、利用しやすさの6つからなっている。これらの6つの次元がそれぞれいくつかの要素、それらの要素がいくつかの指標から成るという構造となっている。それぞれの次元の内容については以下のとおりである。

**0. 品質の要件**：統計の品質の要件あるいは制度的前提条件である。

**1. 規範性の保証**：統計データの収集、作成、普及・公表における客観性の原則に関するものである。この次元には、政策及び実施における専門性、透明性、倫理基準を確保するための制度的調整が含まれる。

**2. 方法の健全性**：統計作成のための方法論の基盤は信頼できる健全なものであるべきで、それは国際的に認められている基準、指針、良い慣行に従

うことによって達成できるという考え方である。この次元は、データセットによって異なっている。

**3. 正確性・信頼性**：統計データが経済の実態を十分に表すべきという考え方である。この次元は、データ固有のものである。

**4. 実用性**：時期を逸することなく適切な周期をもって統計データを公表すること、当該統計データとその他の統計データに一貫性があること、当該統計は定期的な見直し方針に従うこと、に関連するものである。

**5. 利用しやすさ**：データ及びメタデータが明確で理解しやすい方法で表示され、公平かつ容易に入手できること、メタデータは最新かつ適切であること、迅速で充実した支援サービスが提供可能であること、に関連するものである。

日本の6つのデータセットについて、上記の6つの次元ごとの各要素ごとにこれらの評価基準に基づき5段階で行われた評価は、評価報告書に添付された表に要約されているので、参考までに次頁に掲載した。

なお、ROSCでは、各国の評価を行う中で、使用する評価基準(DQAF)等について修正を加えているので、評価時点の異なる国同士の評価を単純に比較することはできない。今回の日本の報告書は2003年7月版のDQAFに基づくものである。

## 3 CPIに関する評価の概要

日本のCPIは概ねDQAFの基準を満たしており、「2. 方法の健全性 2.2 範囲」と「3. 正確性・信頼性 3.3 統計技術」の2項目についてわずかに逸脱が認められるに過ぎない(表参照)。

報告書の中で、高い評価を受けている点をいくつか上げると以下のとおりである。

① CPIの新規公表内容が閣議という重要な場面で報告されることにより、CPIが威厳のあるもの

となっている。(1.1.1)

②データ源と統計技術は統計的基準によって決められている。(1.1.2)

③CPIへの批判に対して先取的に詳細な内容を「Q&A」として統計局のホームページに掲載している。(1.1.3)

④統計局はCPIの制度的仕組みの要約をウェブサイトに掲載している。(1.2.1)

⑤メタデータにおける5年ごとの見直しに関する

資料は整備されている。(1.2.4及び5.2.1)

⑥データ範囲とデータ源はおおむねCPIマニュアルと1993SNAの原則に従っている。(2.1.1)

⑦パソコン及びデジタルカメラの指数作成において、全国の大型電気量販店で販売された全商品の価格、数量、機能についてのスキャナ(POS)データを利用していることはCPIマニュアルで推奨されている。(3.1.1)

⑧調査が困難な品目について年に4回出回り状況

表 日本：データ品質評価フレームワーク(DQAF) 2003年7月版—結果概要<sup>1</sup>

記号：O=遵守、LO=概ね遵守、LNO=概ね未遵守、NO=未遵守、NA=該当なし						
データ・セット	国民経済計算	消費者物価指数	企業物価指数	政府財政統計	金融統計	国際収支統計
次元/要素						
<b>0. 品質の要件</b>						
0.1 法的・制度的環境	O	O	O	LO	O	LO
0.2 資源	LNO	O	O	O	O	O
0.3 関連性	O	O	O	O	O	O
0.4 その他のクオリティ管理	O	O	O	O	O	O
<b>1. 規範性の保証</b>						
1.1 専門性	O	O	O	O	O	O
1.2 透明性	O	O	O	O	O	O
1.3 倫理基準	O	O	O	O	O	O
<b>2. 方法の健全性</b>						
2.1 概念と定義	O	O	LO	O	LO	O
2.2 範囲	O	LO	O	LNO	LO	O
2.3 分類/セクター分け	O	O	O	O	LO	LO
2.4 記録の基礎	O	O	O	O	LO	O
<b>3. 正確性・信頼性</b>						
3.1 元データ	LO	O	LO	LO	O	LO
3.2 元データの評価	LO	O	O	O	O	O
3.3 統計技術	O	LO	LNO	O	O	O
3.4 中間データと統計アウト プットとの評価・確認	O	O	O	O	O	O
3.5 見直し研究	LNO	O	O	LO	O	O
<b>4. 実用性</b>						
4.1 周期性と適時性	O	O	O	LNO	O	O
4.2 一貫性	O	O	O	LO	O	O
4.3 改定方針と実施	O	O	O	O	O	LNO
<b>5. 利用しやすさ</b>						
5.1 データへのアクセス	O	O	O	O	O	O
5.2 メタデータへのアクセス	O	O	O	O	O	O
5.3 利用者への支援	O	O	O	O	O	O

遵守 (O)：現在の実施状況は、重大な欠陥もなく、国際的に承認された統計事例であるDQAFの基準に基本的に合致し達成している。

概ね遵守 (LO)：いくつかの逸脱はあるものの、それらは当局のDQAFを遵守する能力に疑問を抱くほど重大なものではない。

概ね未遵守 (LNO)：重大な逸脱があり、当局はDQAFを遵守するために対策を講じる必要がある。

未遵守 (NO)：ほとんどのDQAFの基準は達成されていない。

適用なし (NA)：統計的な基準がその国の環境に適用されない場合に例外的に使用する。

1 次元0及び1については、国民経済計算の評価は内閣府、消費者物価指数は総務省、政府財政統計は財務省、企業物価指数、金融統計及び国際収支統計は日本銀行に対して行われている。

調査を行い、市場での商品の出回りを確認し、基本銘柄の選定に役立てている。(3.1.1)

⑨ウエイトと価格の更新は適切な時期に行われている。生鮮食品については、毎月、上・中・下旬の3回調査されている。また、東京都区部の速報を当月末頃に公表している。(3.1.3)

⑩日本のCPIで公表している中間年バスケット指数は、リアルタイムに最良指数に近い値を提供するものとしてCPIマニュアルで画期的方法と論じられているものである。(3.3.1)

⑪全般的に、利用しやすさと細かさは模範的であり、利用者に大いに役立っている。(5.1.1)

⑫一般向けに作成されているCPIの概要は詳細な付属文書の付いた極めて幅広いものである。(5.2.2)

⑬ポータルサイト、統計インデックスなどは、透明性と詳細度という点で極めて優れている。(5.3.2)

一方、報告書において、改善すべきとの提言を受けた点は以下のとおりである。

①対象範囲を拡大し、単身世帯を対象範囲に含めるとともに、元データについても同様の改良を加えること。また、店舗の選定の有効性を確認するために店舗形態に着目した標本設計の見直しについても検討すること。(2.2.1及び3.1.1)

②継続期間7日間以下のセール価格を含めること。(2.4.1)

③下位レベルの主な算式としてDutot式(算術平均の比)の使用を見直すこと。また、上位レベルの算式としてLowe指数を検討すること。さらに、ウエイトの改定をもっと頻繁に行うことを検討すること。(3.3.1)

④一時的に欠損する品目、季節商品の取扱及び品質調整法について検討すること。(3.3.2)

#### 4 提言に対する統計局の対応

ROSCではIMFが作成した報告書と統計作成部局による回答を併せて公表している。提言を受けた点に対する2006年3月における統計局の回答は以下の通りである。

##### ①単身世帯を対象範囲に含めること及び店舗形態に着目した標本設計の見直しの検討について

最近の単身世帯の増加に伴い、単身世帯を含む総世帯の消費構造に基づいた年平均指数を参考系列として2000年基準から毎年作成しており、2005年では、公式指数(二人以上世帯)は総世帯指数より0.1だけ高くなっている。

ユーザーの様々な要望に対応するために、2005年基準から参考系列として、総世帯指数の月次結果を作成することとしている。

さらに、CPIの範囲に単身世帯を含めることについて、今後、ユーザーの意見も参考にしながら検討を進めていく予定である。

一方、日本では、いたるところで次々と店舗の開設や閉鎖が行われるため、店舗形態に依存する方法で標本抽出のためのフレームを整備すべきでないと考え。標本抽出のためのフレームは、社会の変化によって簡単に影響されない地域の境界のような、より固定された構造に沿って定められるべきものと考え。

##### ②継続期間7日間以下のセール価格を含めることについて

価格は平日である水曜日、木曜日、金曜日のいずれかに収集されているが、収集した価格は月の価格を代表している。7日以内の「特売価格」は、その月の最も販売の多かった価格でない可能性が

高い。例えば、ある製品が毎週金曜日にだけ「特売価格」で売られるならば、その価格は月の価格を代表する価格と考えることはできない。そのため、そのような価格は除外する必要がある。

### ③下位算式及び上位算式の見直し及びウエイトの改定間隔の検討について

銘柄規定は厳格であり、それぞれの品目の財又はサービスは均一か、少なくともほとんど均一であるとみなせるため、Dutot 式、Jevons 式（比の幾何平均）のいずれも下位算式として許容できる。

毎年ウエイトを更新する連鎖指数は、1975年以降公表されている。

消費構造の変化はさほど大きくなく、公式指数と連鎖指数の差は2000年基準の2005年の結果でわずか0.4ポイントである。また、公式指数と連鎖指数の差の絶対値は、次の基準年（基準年の5年後）で0.5未満であった。

さらに、ユーザーの様々な要望に応えるため、2005年基準改定では、生鮮食品を除く総合指数について毎月連鎖指数を公表することとしている。

しかし、連鎖指数には加法整合性がないという欠点がある。CPI に関しては、日本では、変動の要因を毎月明確にしなければならぬため、連鎖指数に加法整合性がないということは深刻な問題である。日本では、多くのユーザーが、総合のみならず分類ごとの変化を見ている。西欧諸国の多くでは、基準年が長い期間固定されているため、連鎖指数が公式指数とされている。しかし、日本では基準年は5年ごとに改定され、改定された結果も、基準年後8か月以内に公表されている。したがって、ウエイトを固定する指数とウエイトを更新する指数の間の差は小さい。

### ④一時的に欠損する品目、季節商品の取扱及び品質調整法の検討について

日本の CPI は、一時的な欠測値、季節商品の取扱及び品質調整について、ILO マニュアルによって認められている方法で作成されている。しかし、消費者が購入する財とサービスは多様化しているため、より精度の高い指数を作成するために品質調整法を改善すべきであると考えられる。

以上が2006年3月における統計局の回答内容であるが、総世帯指数や連鎖指数を月次で公表するといった今回の基準改定で予定されていた改定はそのまま実現することとなった。

しかし、新旧基準の指数の差が大きかったことを踏まえると、③について付言する必要がある。最近の市場や消費構造を踏まえると、ウエイトの改定だけでは消費構造の変化を反映させることができないという事情がある。つまり、消費構造を正確に反映させるには、品目の改定やモデル式の見直し等も併せて行うことが必要であり、連鎖指数ならば消費構造を反映しているということにはならない。日本では、基準改定は5年に1度であるが、その際に住宅・土地統計調査や全国消費実態調査など5年に1度実施される大規模統計調査の結果を用いてこの見直しを緻密に行っている。改定の頻度だけでなくその内容を踏まえた評価が必要であると考えられる。

## 5 まとめ

今回、CPI は国際的に見て重要な統計として評価の対象とされ、制度的環境から情報提供までの詳細な側面がチェックポイントとなっていたことから、CPI に関する日常の取組の一つ一つの重要性を強く認識した。

---

---

また、IMF の ROSC を受け入れたことによって、長期に及び詳細なやり取りが行われ、それによる事務の負担は膨大であったが、日本の CPI が世界基準に照らして高い水準にあることが確認できたことは、作成担当としての自信となった。同時に、現在の CPI が抱えている問題点を把握することができ、また、それらについて各国の状況を知っている専門家と意見交換を行う機会が持てたことも非常に有益であった。

今後は、次回の基準改定に向けての検討の中で、これらの諸問題に対しても検討を深め、可能な改善を進めていきたいと考えている。

**参考**

Statistics Department IMF, Data Quality Assessment Framework (DQAF) for the Consumer Price Index, July 2003  
IMF, Japan: Report on Observance of Standards and Codes-Data Module, Response by the Authorities, and Detailed Assessments Using the Data Quality Assessment Framework (DQAF), March 2006

(しみず まこと・総務省統計局統計調査部  
消費統計課物価統計室長)  
(ながい けいこ・総務省統計局統計調査部  
消費統計課物価統計室物価指数第一係長)