第9章 実証分析を行うにあたって

9.1 データの入手

e-Stat https://www.e-stat.go.jp/ (政府統計ポータルサイト)

『日本統計年鑑』 http://www.stat.go.jp/data/nenkan/index1.html

内閣府 統計情報 · 調査結果 https://www.cao.go.jp/statistics/index.html

総務省 統計局 http://www.stat.go.jp/index.html

日本銀行 統計 https://www.boj.or.jp/statistics/index.htm/

素性の確かなところからデータを入手すること!!

●アメリカのデータ:

Economic Report of the President https://www.govinfo.gov/app/collection/erp

データの入手(その 1): 『日本統計年鑑』 http://www.stat.go.jp/data/nenkan/index1.html





データの入手(その2): 総務省 統計局 http://www.stat.go.jp/index.html



「統計局ホームページ」を選択



実証分析の例として,3回目の練習問題の生鮮魚介の需要関数の推定手順を説明する。

「5 家計調査」を選択

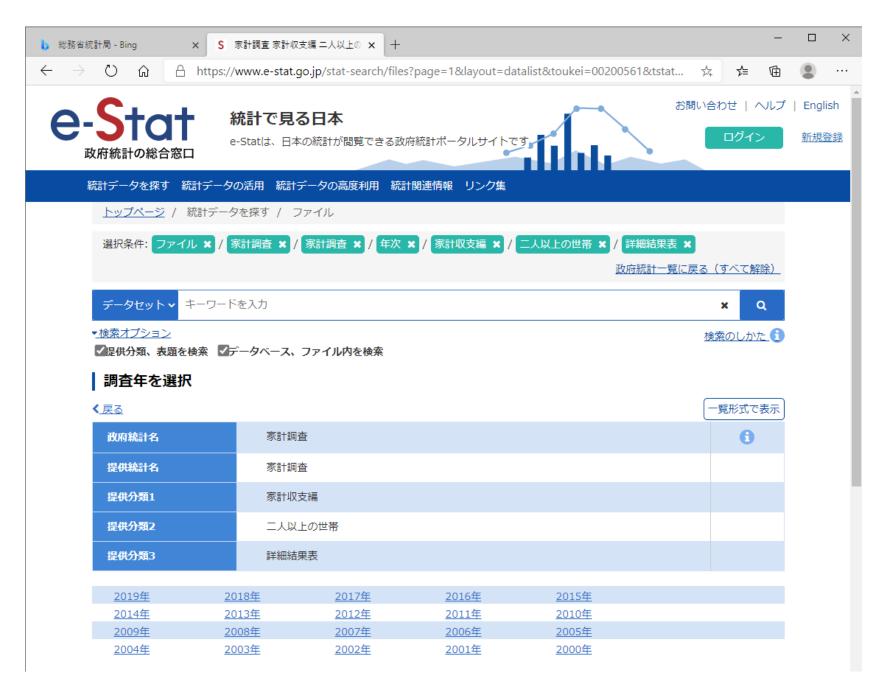




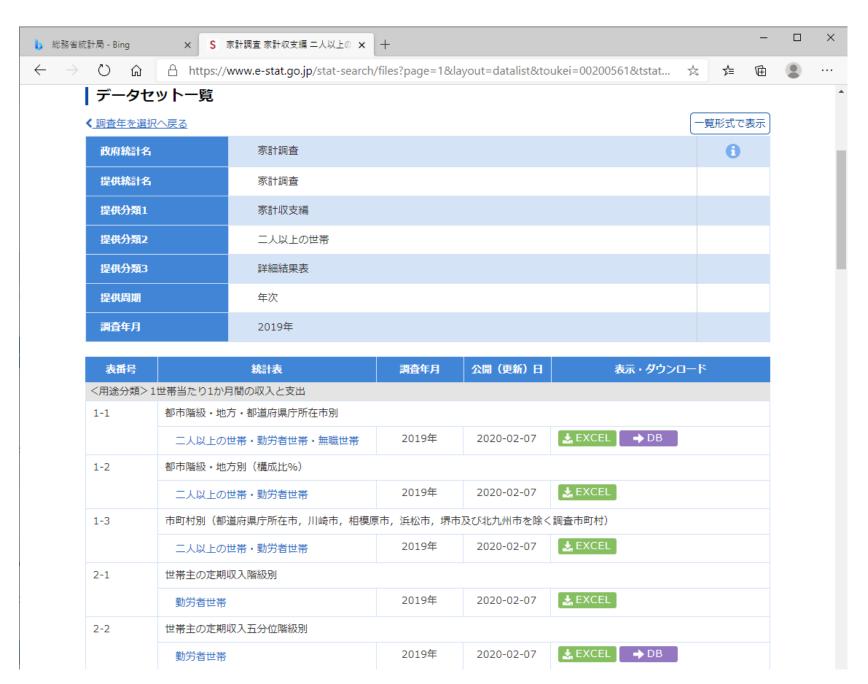
「統計表一覧」を選択



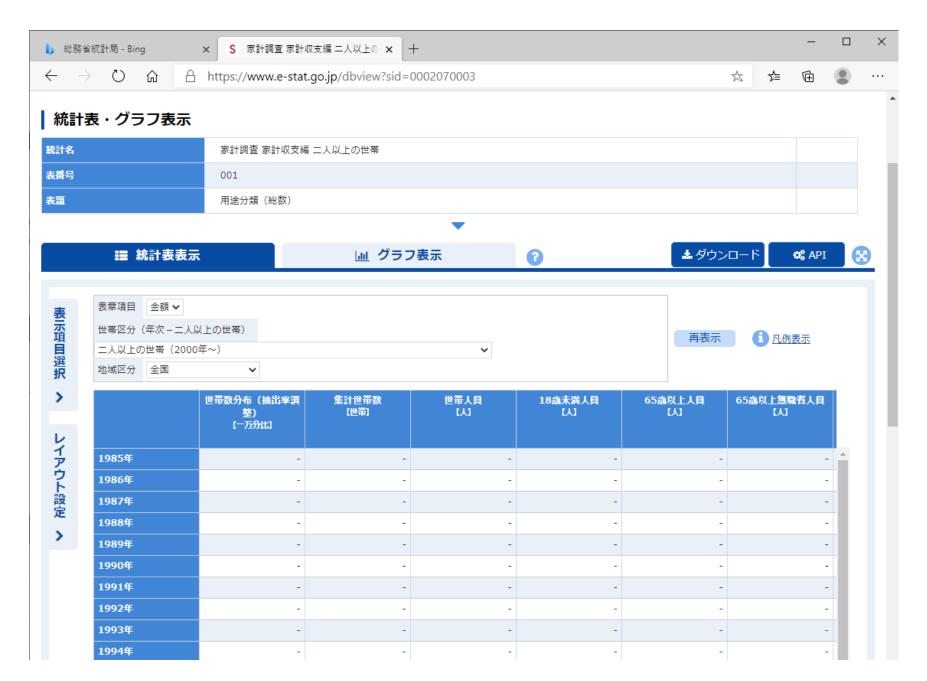
「二人以上の世帯」「年」を選択



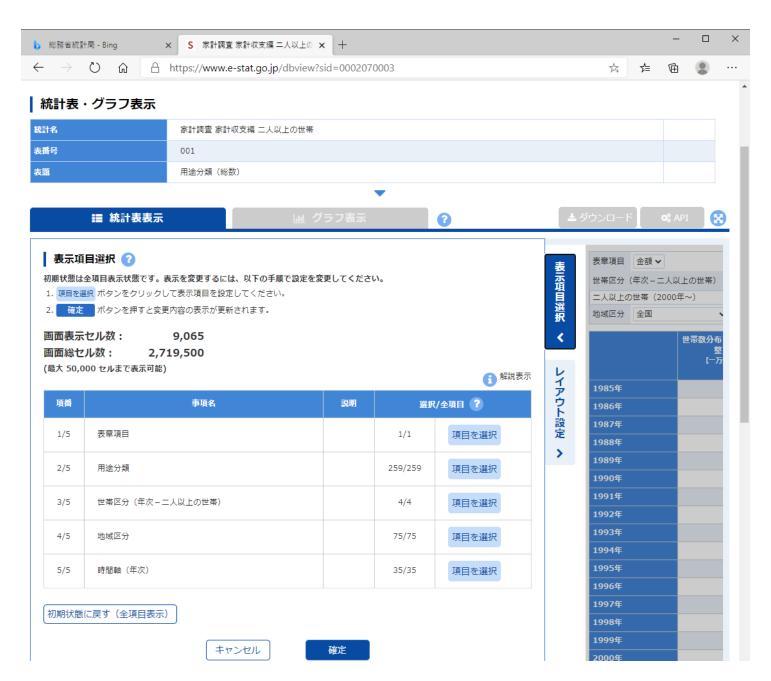
「2019年」を選択



「1-1 二人以上の世帯・勤労者世帯・無職世帯」の「**■→**DB■」を選択



「勤め先収入」を所得として使う。そのために、「表示項目選択」タブを選択する。



「項番」の「2/5」~「4/5」を順次選択



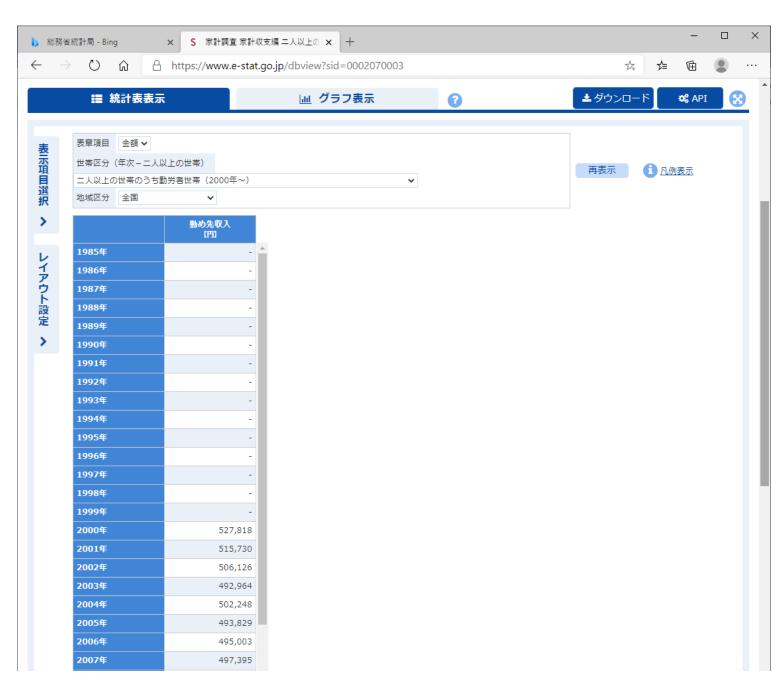
- 「2/5 用途分類」では、「全解除」を押して、「勤め先収入」のみにチェックを入れ、「確定」ボタンを押す。
- 「3/5 世帯区分(年次—二人以上の世帯)」では、「二人以上の世帯のうち勤労者世帯(2000年~)」にチェックを入れて、「確定」ボタンを押す。

「4/5 地域区分」では、「全解除」を押して、「全国」にチェックを入れ、「確定」ボタンを押す。

下の画面へ。



「確定」ボタンを押す。



「ダウンロード」を押す。

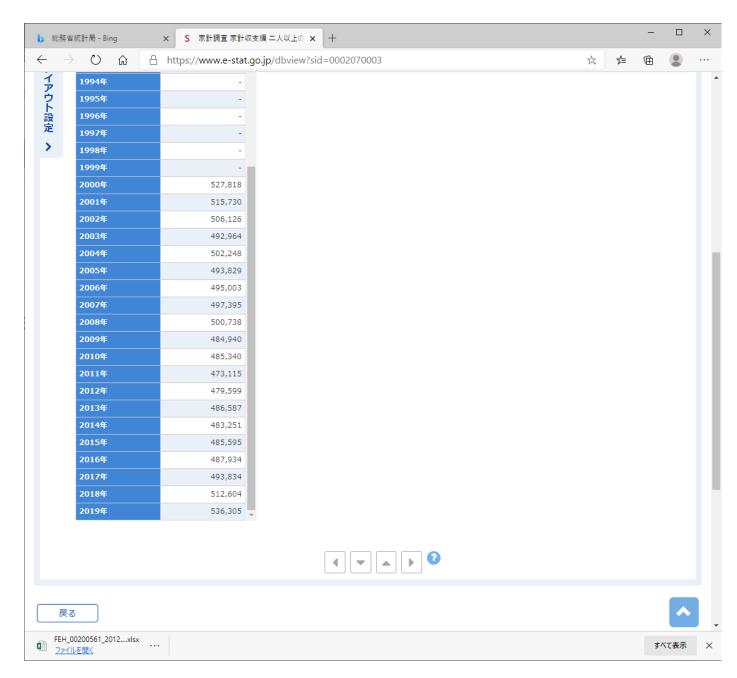


「ファイル形式」で、「XLSX 形式」にチェックを入れて、「ダウンロード」を押す。



「ダウンロード」を押す。

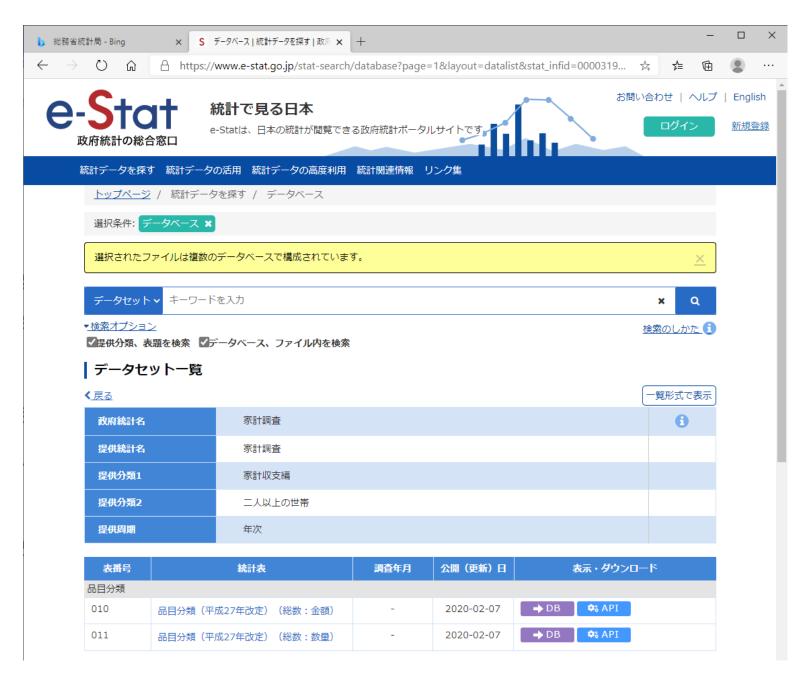
(*) 「練習問題 No.3」では,「勤め先収入」でなく「経常収入」を使っていました。以下の推定結果は,「勤め先収入」を使うので「練習問題 No.3」のものと異なります。



さらに、「戻る」ボタンを押して、次の画面に戻る。



「4-1 二人以上の世帯・勤労者世帯・無職世帯」の「■→DB■」を選択



同様の過程で、金額と数量をダウンロードする。

「010 品目分類(平成 27 年改定)(総数:金額)」で、「**DB**」を選択

「表示項目選択」

「2/5 品目分類(27年改定)」,「1.2.1 生鮮魚介」,「1.3.1 生鮮肉」,「1.5.1 生鮮野菜」,「確定」

「3/5 世帯区分(年次-二人以上の世帯)」、「二人以上の世帯のうち勤労者世帯(2000年~)」、「確定」

「4/5 地域区分」,「全国」,「確定」

「確定」

「ダウンロード」

「XSLX 形式」、「ダウンロード」

「ダウンロード」

「ダウンロード」

「戻る」

「011 品目分類(平成 27 年改定)(総数:数量)」で、「**DB**」を選択

「表示項目選択」

「2/5 品目分類 (27年改定)」、「1.2.1 生鮮魚介」、「1.3.1 生鮮肉」、「1.5.1 生鮮野菜」、「確定」

「3/5 世帯区分(年次-二人以上の世帯)」、「二人以上の世帯のうち勤労者世帯(2000年~)」、「確定」

「4/5 地域区分」,「全国」,「確定」

「確定」

「ダウンロード」

「XSLX 形式」、「ダウンロード」

「ダウンロード」

「戻る」

「https://www.stat.go.jp/index.html」に戻り、消費者物価指数をダウンロードする。

「11 消費者物価指数 (CPI)」を選択

「調査の結果」

「3 時系列データ」、「全国(品目別価格指数)」

「全国(品目別価格指数)」の「年平均(1970年~)」を選択

「1 中分類指数 (1970 年~最新年)」の「<a>GSV」を選択

以上、4つのファイルをダウンロード

以下,

・データの変換 → 時系列データで金額データの場合は、必ず、

物価指数を使って、名目データから実質データに

- ・推定
- 解釈

へと進む。







gret I コンソール: helpと入力するとコマンドのリストが表示されます ? **genr** ry=y/(cpi/100) 系列 ry (ID 9) を作成しました **? genr** ly=log(y/(cpi/100)) 系列 ly (ID 10) を作成しました ? genr lf=log(f) 系列 If (ID 11) を作成しました ? **genr** lpf=log((fy/f)/(cpi/100)) 系列 lpf (ID 12) を作成しました <mark>? genr</mark> lpm=log((my/m)/(cpi/100)) 系列 lpm (ID 13) を作成しました

? genr lpv=log((vy/v)/(cpi/100)) 系列 lpv (ID 14) を作成しました? ols If const ly lpf lpm lpv

モデル 1: 最小二乗法(OL8), 観測: 2000-2019 (T = 20) 従属変数: If

| | 係数 | 標準誤差 | t値 | p値 | |
|----------------------------------|---|---|---|--|------------------|
| const ly lpf lpm lpv | -31.6455 3.20087 -2.20911 1.97548 -0.149690 | 10.9934 0.864304 0.415514 0.537445 0.622409 | -2.879 3.703 -5.317 3.676 -0.2405 | 0.0115 0.0021 8.63e-05 0.0022 0.8132 | ** *** *** |

| Mean dependent var | 10.27204 | S.D. dependent var | 0.258131 |
|--------------------|-----------|--------------------|-----------|
| Sum squared resid | 0.102821 | S.E. of regression | 0.082793 |
| R-squared | 0.918783 | Adjusted R-squared | 0.897126 |
| F(4, 15) | 42.42280 | P-value(F) | 5.24e-08 |
| Log-likelihood | 24.32624 | Akaike criterion | -38.65247 |
| Schwarz criterion | -33.67381 | Hannan-Quinn | -37.68058 |
| rho | 0.647666 | Durbin-Watson | 0.677734 |

Log-likelihood for f = -181.115

