

制度部門間の資金循環統計の推計

真鍋雅史

〈要 旨〉

各金融商品の貸借関係を制度部門ごとに示した統計は、日本銀行『資金循環統計』に公表されているが、全ての制度部門間の資金の貸借関係を捉えたデータは利用可能ではない。しかし、この制度部門ごとの統計を按分推計すれば、制度部門間の資金循環統計が推計できる。本稿の目的は、この方法で得られた推計結果を、部分的に公表されている制度部門間の資金の貸借に関する別の統計と比較することにより、どの程度の精度を持っているかを明らかにすることにある。分析結果としては、問題意識にあわせて制度部門を統合すれば、現実の値に十分近づいていくことがわかった。ここから、このような手法で推計された制度部門間の資金循環統計は、精度的には、資金調達や資産選択に関するさまざまなマクロ実証分析に利用可能といえる。

© Japan Society of Monetary Economics 2010