

[2017_2_40_014]

マクロ計量モデルの利用と応用
(調査研究報告書)

植村 仁一 編

2018年3月14日

独立行政法人日本貿易振興機構
アジア経済研究所

調査研究報告書

開発研究センター [2017_2_40_014]

東アジアの計量モデル：その利用と応用

はじめに

本書は平成 29 年度アジア経済研究所「マクロ計量モデルの利用と応用」研究会の中間報告書である。本研究会は「マクロ計量モデルの基礎と応用」を最終成果として出版・終了した前年度の「東アジアの計量モデル分析」の後継事業であり、遠くは 1980 年代からアジア経済研究所で脈々と受け継がれてきたマクロ計量モデルを活用した分析・予測事業の後継事業と位置づけられる。平成 19 年度をもってそれまで 30 年近く続いてきた東・東南アジアのマクロ経済予測事業が終了した。その間に蓄積された情報やノウハウの散逸を防ぐのを目的の一つとして、平成 21 年度に基礎理論研究会「政策評価のためのマクロ計量モデル研究」が発足し、翌年度から経常研究会「アジア長期経済成長のモデル分析」(I~V)において、さらに人口や貿易面からの新たな視点も加味したマクロ計量分析の枠組み構築を行ってきた。本研究会はそれら枠組みを引き継ぎ、さらに深化させることを目指している。

本報告書の内容は以下の通りである。第 1 章(田口)「アジアを中心とする貿易自由化の効果に関する研究レビュー」は、進展する貿易自由化の流れを CGE モデルや貿易グラビティモデルといったさまざまなアプローチで定量的にとらえる先行研究のレビューである。こうしたレビューを通じ、本事業で活用するマクロ計量モデルによるアプローチの位置づけを明確にできる。第 2 章(カイ)「東アジアの貿易構造とマクロ経済的リンケージ」では、特にタイを例に挙げ、東アジア域内国同士の間接貿易の重要性、具体的には米国等の域外国への最終財輸出がもたらす域内他国との間接貿易の増大を、ブロック外生 VAR モデルを用いて検証する。第 3 章(植村)「ComTrade データによる基準年価格指数の算出と評価」は、国連 Comtrade データベースから抽出してある各国の財種別輸出入データを用い、2010 年固定基準年を仮定した価格指数作成を試みる。そのうえで、既に作成・運用している連鎖指数との比較検討を行う。第 4 章(石田)「ベトナム実質国民所得統計の推計とモデル作成」では、ADB が公表するデータを援用してベトナムの国民所得統計の各系列を延長する試みである。マクロ計量モデルでは一定以上の長さの時系列データが必要であるが、特に後発国では統計が十分に整備されていない例がしばしば見られる。そこで、国際機関が推計したデータを(全体をそのまま分析に使うのではなく)活用することにより、当該国の元データに沿った延長を行うものである。3 人の内部委員による第 5 章「モデル分析用資本ストック系列の推定」は、各国モデルに組み込むための資本ストック系列の算出について、これまで各担当者が思い思いのやり方で作成してきたものを、Vu(2001)を参考に統一的方法を導入する「作業報告」的な位置づけである。

巻末「資料篇」には、リンク対象 19 か国・地域について、ラオスとミャンマーを除く各国マクロ計量モデルの概要と推定結果、変数リストなどを一覧に掲載している。また、3 章(植村)で行った Comtrade データベースの SITC 品目分類で、基準年とする 2010 年と同一の品目がどの程度遡って存在しているのかを一覧している。

以上

平成 29 年度「東アジアの計量モデル：その利用と応用」研究会

主査・幹事 植村仁一（開発研究センター・経済モデル研究グループ長）

委員（内部）

石田正美（開発研究センター長）

渡辺雄一（地域研究センター・東アジア研究グループ）

委員（外部）

田口博之（埼玉大学・人文社会科学研究科教授）

ブー・トゥン・カイ（法政大学・経済学部准教授）

目次

はしがき

第1章 アジアを中心とする貿易自由化の効果に関する研究レビュー	1
田口 博之	
第2章 東アジアの貿易構造とマクロ経済的リンケージ	13
ブー・トゥン・カイ	
第3章 ComTrade データによる基準年価格指数の算出と評価	40
植村 仁一	
第4章 ベトナム実質国民所得統計の推計とモデル作成	51
石田 正美	
第5章 モデル分析用資本ストック系列の推定	74
植村 仁一	
石田 正美	
渡邊 雄一	

資料篇：

各国マクロモデル推定結果	79
(1) モデル推定担当者一覧	80
(2) 各国・地域モデル	81
1. オーストラリア	81
2. 中国	90
3. 香港	99
4. インドネシア	107
5. インド	116
6. 日本	125

7. カンボジア	134
8. 韓国	141
9. マレーシア	150
10. ニュージーランド	159
11. フィリピン	168
12. シンガポール	176
13. タイ	185
14. 台湾	193
15. 米国	202
16. ベトナム	211
17. ユーロ地域	219
(3) 変数名一覧	226
(4) リンクモデルとの接続ブロック例示	245
(例) オーストラリア	
(5) モデル全体像例示	247
(例) マレーシア	
(6) 第3章 (植村) 資料編	249

調査研究報告書
開発研究センター 2017_2_40_014
東アジアの計量モデル：その利用と応用

2018年3月31日発行
発行所 独立行政法人日本貿易振興機構
アジア経済研究所
〒261-8545 千葉県千葉市美浜区若葉 3-2-2
電話 043-299-9500
無断複写・複製・転載などを禁じます。
