

個人家計別物価指数の構築と分析

北村行伸*

一橋大学経済研究所

2006年8月16日

概要

本稿は消費者物価指数を全国消費実態調査の個票情報を用いて、各家計別に物価指数を構築し、それに家計属性やマクロ経済変数を加えることで、従来行われてきた物価分析に新たな視点を加えようとするものである。具体的には、平成11年度(1999)の全国消費実態調査の各家計の消費バスケットに政府の消費者物価指数で用いられている品目別価格データを適用することによって個人家計別消費者物価指数を計算した。この指数によって価格の変動が個別家計にどのような影響を与えたかを統計的に検証した。その結果、前年同月比で測った個人家計別物価指数は正規分布に従っていること、その指数には粘着性があり、家計毎に固定効果が見出されること、40-49歳世代の物価指数が最も高く、65歳以上の高齢者の指数は低いこと、18歳以下の子供が多いほど、物価指数は高くなること、東京や大阪などの大都市の物価指数は一般に高いが、2000-2005年には物価下落も大きかったことなどがわかった。個人家計別物価指数はその分布情報など金融政策にとって有益な情報を提供してくれる。

Key Words: 個人家計別物価指数, 指数問題, 価格変動, パネルデータ分析

JEL classification: C43, E21, E31.

*本稿において用いた『平成11年(1999)度全国消費実態調査』の個票データは2005年度に総務省統計局から目的外利用の許可を得たものである。総務省統計局に対して感謝したい。またプログラムの一部は坂本和靖(家計経済研究所)氏の助力を得た。マクロ金融データの入力は大井博之(日本銀行金融研究所)氏の手を煩わせ、図表の入力等は北村研究室の原美起氏に手伝っていただいた。皆さんの協力を感謝したい。本稿は日本銀行金融研究所セミナー(2006年2月17日)で発表された。参加者の白川方明、西村清彦、白塚重典、藪友良、その他多くの方から有益なコメントを頂戴した。連絡先: 〒186-8603 国立市中2-1 一橋大学経済研究所、e-mail: kitamura@ier.hit-u.ac.jp.