

IMF によるデータ評価について

IMF では、金融危機の防止の観点から金融・経済データをタイムリーに公表するための公表基準（SDDS）を、及び IMF の融資・監視業務における各国の経済・金融データの品質の向上のため金融・経済データの品質を評価するためのフレームワーク（DQAF）を策定している。また、IMF ではこれら SDDS 及び DQAF を用いて各国の金融・財政統計データの品質や基準の内容に関する評価の報告（ROSC）を行っている。概要は以下のとおり。

I IMF 特別データ公表基準（SDDS）

SDDS（Special Data Dissemination Standards）は、1994 年のメキシコ金融危機を契機に、IMF が 1996 年 3 月に策定したもので、金融危機への未然の防止のためには、各国経済活動の透明性の確保のための正確かつタイムリーな経済・金融情報の開示が必要との認識の下、IMF が 1996 年 3 月に策定された金融・財政統計データの公表基準である。SDDS は、国際資本市場に参加する国が任意に加入するものであり、実物経済部門、財政部門、金融部門、対外部門の 4 つの部門に公表すべきデータカテゴリー項目を定めており、2008 年 1 月現在 64 カ国が加入している。我が国は 1996 年 4 月以降 SDDS に加入しており、2000 年 6 月にその基準の遵守を達成している。SDDS は、以下の 4 つの基準からなっている。

1 データの範囲、公表周期、公表までの期間

2 一般からのアクセス

- (1) 公表予定を事前に公表すること（ユーザーのデータへの計画的アクセス）
- (2) 一般に対しても公表を同時にすること（データのアクセスへの平等性の確保）

3 データの規範性

統計データ作成に際してのユーザーに対する信頼性の確保のため、データ作成にかかる規定や諸条件や統計作成機関の客観性・専門性に関する情報を提供すること。

- (1) 個人情報の秘匿情報措置など統計作成に当たっての諸条件の公表
- (2) 公表前の政府部内で当該統計へのアクセスの有無の明示
- (3) 公表の際の政府コメントの有無の明示
- (4) 統計の改訂に関する情報の提供及び統計作成方法に大きな変更がある際の事前周知

4 データの品質

- (1) 統計作成の際に使われる方法及びデータソースに関する文書の公表
- (2) データ内容の詳細、関係データとの整合性、クロスチェックを通じたデータの妥当性を確認することができる統計的フレームワークの公表

SDDS に加入した国は、上記の基準を遵守してデータ公表活動を行っていることの説明を IMF の公表基準掲示板 (DSBB) (<http://dsbb.imf.org>) に提示するとともに自国のウェブサイト上に SDDS 対象データ一覧表 (National Summary Data Page) を公表することとなっている。

II IMF データ品質評価フレームワーク (DQAF)

IMF は 1997 年頃から IMF が行う融資及び監視業務に必要な各国の経済・金融統計データの一層の品質向上の必要性を認識し、データ品質の評価フレームワークの開発に着手し、2001 年 7 月に DQAF (Data Quality Assessment Framework) を開発した。

DQAF は、統計データの品質の評価基準であり、統計制度、統計作成プロセス及び作成された統計データそのものの管理に求められる品質に関する特性を明らかにしたものであり、以下の前提条件及び 5 つの次元 (Dimension) から成る。

1 DQAF の構成

(1) 品質の前提条件 (品質を支える法的・制度的環境等)

① 法的・制度的環境

- ・統計の収集・処理・公表の責任の所在が明確か
- ・データ作成機関間のデータ共有及び調整が適切か
- ・データの機密性は保証され、統計目的のためか
- ・データ報告を確保するための法律等の措置があるか

② 資源

- ・スタッフ、設備等資源、資金は適切に確保されているか
- ・資源の効率的利用のための措置はとられているか

③ 関連性

- ・統計利用者のニーズのための既存統計の関連性及び利用の監視

④ その他品質管理

- ・品質に焦点を当てたプロセスが整備されているか
- ・作業のプロセスを監視するしくみはあるか
- ・統計プログラム立案にあたっての検討事項に対処するプロセスはあるか

(2) 5 つの次元

① 規範性の保証

ア 専門性

- ・統計が偏りなく公平に作成されているか
- ・元データ、統計技術の選択、公表は統計的な観点のみからなされるか
- ・統計機関が統計の誤用等に関して適切に対処する権限を持つか

イ 透明性

- ・統計作成のプロセス及び公表にかかる情報を一般が入手できるか
- ・公表前の政府内部における統計へのアクセスは公に認識されているか
- ・統計作成機関が当該作成物に明示されているか
- ・統計の方法論、元データに主要な変更がある場合の事前通知はあるか

ウ 倫理基準

- ・統計スタッフの行動基準が明確にされ、周知されているか

② 方法の健全性

ア 概念と定義

- ・統計作成にかかる概念と定義は国際的に使用される基準、指針か

イ 範囲

- ・統計作成のための範囲は国際的に使用される基準、指針か

ウ 分類／セクター分け

- ・使用される分類／セクター分けは国際的に使用される基準、指針か

エ 記録の基礎

- ・フローとストックには市場価格が用いられているか
- ・記録は発生主義で行われているか
- ・グロス及びネットの手続きは国際的に使用される基準、指針か

③ 正確性・信頼性

ア 元データ

- ・元データは国の固有事情を考慮した包括的なデータ収集か
- ・元データは要求される定義・範囲・分類・評価・評価時期に合致しているか
- ・元データには適時性はあるか

イ 元データの評価

- ・センサス、標本調査、行政記録を含む元データは経常的に評価されているか。
評価結果はモニターされ、統計プロセスの指針となっているか

ウ 統計技術

- ・データ作成には信頼できる統計技術を使っているか
- ・その他の統計手順（データ調整や分析等）では適切な統計技術を使用しているか

エ 中間データと統計アウトプットの評価・確認

- ・中間結果を他の情報に照らして確認しているか
- ・中間データにおける統計上の不突合について評価し、調査しているか
- ・統計アウトプットにおける統計上の不突合やその他の問題となり得る指標について調査しているか

オ 改定のための研究

- ・改定のための研究・分析が定期的になされ、統計プロセスを報告するために内部的に利用されているか

④ 実用性

ア 周期性と適時性

- ・周期性及び適時性は公表基準に沿ったものか

イ 一貫性

- ・統計結果に一貫性があるか
- ・他の統計結果と一貫性があるか

ウ 見直しの方針と実施

- ・見直しは定期的に行われ、スケジュールに沿ったものか
- ・暫定的データや改定データについてはそれが明示されているか
- ・見直しにかかる研究及び分析は公表されているか

⑤ アクセス可能性

ア データへのアクセス

- ・結果のレイアウトや表現方法はわかりやすいものになっているか
- ・公表の媒体及び形式は適切であるか
- ・統計は事前のスケジュールどおり公表されているか
- ・統計はすべての利用者が同時に利用できるようになっているか
- ・定期的に公表されないデータは、利用者の要請に応じて利用できるか

イ メタデータへのアクセス

- ・概念、範囲、分類、記録の基礎、データソース及び統計技術に関する文書が入手可能であり、国際的に受け入れられた基準、指針又は望ましい慣行と異なる部分については注釈が付与されているか
- ・詳細の度合いは利用者のニーズに合っているか

ウ 利用者への支援

- ・各統計分野についての照会先が公表されているか
- ・出版物、文書の目録、料金情報を含むその他情報を広く利用できるか

なお、DQAF は SDDS とともに、次のⅢの ROSC を作成する上での評価基準の一つとなっている。

Ⅲ IMF の基準・規範の遵守状況に関する報告書 (ROSC)

ROSC (Report on the Observance of Standards and Codes) とは、IMF が世界各国で起こり得る金融危機を未然に予防する観点から、加盟国における金融・財政政策などの分野に関する基準や規範の遵守状況について評価を実施し、取りまとめている報告書である。ROSC は、以下の 12 の分野について実施され、その結果を取りまとめている。

- 1 データ品質
- 2 金融・財政政策の透明性
- 3 財政の透明性
- 4 銀行監督
- 5 証券規制
- 6 保険
- 7 支払・決済システム
- 8 マネーロンダリングの防止
- 9 コーポレートガバナンス
- 10 会計制度
- 11 監査制度
- 12 破産法制及び債権者の権利

また、この評価及びその結果の公表は加盟国の任意によるものであり、対象国の発展段階や制度面の状況等を反映し、基準や規範の遵守度合いを評価するものであって、格付けや合否の判定を行うものではない。なお、上記 ROSC のうち、1 のデータ品質 ROSC にかかる IMF のミッションを平成 17 年 9 月に受け入れ、6 つのマクロ経済統計分野について、IMF の評価を受け、その結果を平成 18 年 3 月に公表している。

**DATA QUALITY ASSESSMENT FRAMEWORK—GENERIC FRAMEWORK
(JULY 2003 FRAMEWORK)**

Quality Dimensions	Elements	Indicators
0. Prerequisites of quality	<p>0.1 Legal and institutional environment—<i>The environment is supportive of statistics</i></p> <p>0.2 Resources—<i>Resources are commensurate with needs of statistical programs.</i></p> <p>0.3 Relevance—<i>Statistics cover relevant information on the subject field.</i></p> <p>0.4 Other quality management—<i>Quality is a cornerstone of statistical work.</i></p>	<p>0.1.1 The responsibility for collecting, processing, and disseminating the statistics is clearly specified.</p> <p>0.1.2 Data sharing and coordination among data-producing agencies are adequate.</p> <p>0.1.3 Individual reporters' data are to be kept confidential and used for statistical purposes only.</p> <p>0.1.4 Statistical reporting is ensured through legal mandate and/or measures to encourage response.</p> <p>0.2.1 Staff, facilities, computing resources, and financing are commensurate with statistical programs.</p> <p>0.2.2 Measures to ensure efficient use of resources are implemented.</p> <p>0.3.1 The relevance and practical utility of existing statistics in meeting users' needs are monitored.</p> <p>0.4.1 Processes are in place to focus on quality.</p> <p>0.4.2 Processes are in place to monitor the quality of the statistical program.</p> <p>0.4.3 Processes are in place to deal with quality considerations in planning the statistical program.</p>
<p>1. Assurances of integrity</p> <p><i>The principle of objectivity in the collection, processing, and dissemination of statistics is firmly adhered to.</i></p>	<p>1.1 Professionalism—<i>Statistical policies and practices are guided by professional principles.</i></p> <p>1.2 Transparency—<i>Statistical policies and practices are transparent.</i></p> <p>1.3 Ethical standards—<i>Policies and practices are guided by ethical standards.</i></p>	<p>1.1.1 Statistics are produced on an impartial basis.</p> <p>1.1.2 Choices of sources and statistical techniques as well as decisions about dissemination are informed solely by statistical considerations.</p> <p>1.1.3 The appropriate statistical entity is entitled to comment on erroneous interpretation and misuse of statistics.</p> <p>1.2.1 The terms and conditions under which statistics are collected, processed, and disseminated are available to the public.</p> <p>1.2.2 Internal governmental access to statistics prior to their release is publicly identified.</p> <p>1.2.3 Products of statistical agencies/units are clearly identified as such.</p> <p>1.2.4 Advanced notice is given of major changes in methodology, source data, and statistical techniques.</p> <p>1.3.1 Guidelines for staff behavior are in place and are well known to the staff.</p>

Quality Dimensions	Elements	Indicators
2. Methodological soundness <i>The methodological basis for the statistics follows internationally accepted standards, guidelines, or good practices.</i>	2.1 Concepts and definitions — <i>Concepts and definitions used are in accord with internationally accepted statistical frameworks.</i> 2.2 Scope — <i>The scope is in accord with internationally accepted standards, guidelines, or good practices.</i> 2.3 Classification/sectorization — <i>Classification and sectorization systems are in accord with internationally accepted standards, guidelines, or good practices.</i> 2.4 Basis for recording — <i>Flows and stocks are valued and recorded according to internationally accepted standards, guidelines, or good practices</i>	2.1.1 The overall structure in terms of concepts and definitions follows internationally accepted standards, guidelines, or good practices. 2.2.1 The scope is broadly consistent with internationally accepted standards, guidelines, or good practices. 2.3.1 Classification/sectorization systems used are broadly consistent with internationally accepted standards, guidelines, or good practices. 2.4.1 Market prices are used to value flows and stocks. 2.4.2 Recording is done on an accrual basis. 2.4.3 Grossing/netting procedures are broadly consistent with internationally accepted standards, guidelines, or good practices.
3. Accuracy and reliability <i>Source data and statistical techniques are sound and statistical outputs sufficiently portray reality</i>	3.1 Source data – <i>Source data available provide an adequate basis to compile statistics.</i> 3.2 Assessment of source data — <i>Source data are regularly assessed.</i> 3.3 Statistical techniques — <i>Statistical techniques employed conform to sound statistical procedures</i> 3.4 Assessment and validation of intermediate data and statistical outputs — <i>Intermediate results and statistical outputs are regularly assessed and validated.</i> 3.5 Revision studies — <i>Revisions, as a gauge of reliability, are tracked and mined for the information they may provide.</i>	3.1.1 Source data are obtained from comprehensive data collection programs that take into account country-specific conditions. 3.1.2 Source data reasonably approximate the definitions, scope, classifications, valuation, and time of recording required. 3.1.3 Source data are timely. 3.2.1 Source data—including censuses, sample surveys, and administrative records—are routinely assessed, e.g., for coverage, sample error, response error, and nonsampling error; the results of the assessments are monitored and made available to guide statistical processes. 3.3.1 Data compilation employs sound statistical techniques to deal with data sources. 3.3.2 Other statistical procedures (e.g., data adjustments and transformations, and statistical analysis) employ sound statistical techniques. 3.4.1 Intermediate results are validated against other information where applicable. 3.4.2 Statistical discrepancies in intermediate data are assessed and investigated. 3.4.3 Statistical discrepancies and other potential indicators or problems in statistical outputs are investigated. 3.5.1 Studies and analyses of revisions are carried out routinely and used internally to inform statistical processes (see also 4.3.3).

Quality Dimensions	Elements	Indicators
4. Serviceability <i>Statistics, with adequate periodicity and timeliness, are consistent and follow a predictable revisions policy.</i>	4.1 Periodicity and timeliness — <i>Periodicity and timeliness follow internationally accepted dissemination standards.</i> 4.2 Consistency — <i>Statistics are consistent within the dataset, over time, and with major datasets.</i> 4.3 Revision policy and practice — <i>Data revisions follow a regular and publicized procedure.</i>	4.1.1 Periodicity follows dissemination standards. 4.1.2 Timeliness follows dissemination standards. 4.2.1 Statistics are consistent within the dataset. 4.2.2 Statistics are consistent or reconcilable over a reasonable period of time. 4.2.3 Statistics are consistent or reconcilable with those obtained through other data sources and/or statistical frameworks. 4.3.1 Revisions follow a regular and transparent schedule. 4.3.2 Preliminary and/or revised data are clearly identified. 4.3.3 Studies and analyses of revisions are made public (see also 3.5.1).
5. Accessibility <i>Data and metadata are easily available and assistance to users is adequate.</i>	5.1 Data accessibility — <i>Statistics are presented in a clear and understandable manner, forms of dissemination are adequate, and statistics are made available on an impartial basis.</i> 5.2 Metadata accessibility — <i>Up-to-date and pertinent metadata are made available.</i> 5.3 Assistance to users — <i>Prompt and knowledgeable support service is available.</i>	5.1.1 Statistics are presented in a way that facilitates proper interpretation and meaningful comparisons (layout and clarity of text, tables, and charts). 5.1.2 Dissemination media and format are adequate. 5.1.3 Statistics are released on a preannounced schedule. 5.1.4 Statistics are made available to all users at the same time. 5.1.5 Statistics not routinely disseminated are made available upon request. 5.2.1 Documentation on concepts, scope, classifications, basis of recording, data sources, and statistical techniques is available, and differences from internationally accepted standards, guidelines, or good practices are annotated. 5.2.2 Levels of detail are adapted to the needs of the intended audience. 5.3.1 Contact points for each subject field are publicized. 5.3.2 Catalogs of publications, documents, and other services, including information on any changes, are widely available.