

季節調整法の適用に当たっての統計基準の解釈及び運用について

平成 23 年 3 月 31 日

総務省政策統括官（統計基準担当）決定

1 本基準の施行期日

本基準は、平成 23 年 5 月 1 日から施行することとしており、本基準の告示日である平成 23 年 3 月 25 日から約 1 カ月の猶予期間を設けている。これは、本基準に対応した季節調整法の運用に関する情報の公表に一定の準備期間が必要であることを踏まえたことによる。

2 「1 季節調整法を適用する場合の手法」について

- (1) 季節調整の手法としては、諸外国で開発されたものとして X-12-ARIMA (X-12-ARIMA の一部である X-11 を含む。) 及び TRAMO-SEATS があり、我が国で開発されたものとして状態空間モデルに基づく DECOMP が知られているが、「手法の適切性について国際的に一般的な評価を受けている手法」とは、経済時系列データの季節調整の実施に当たり、理論上及び実務上、適切な方法であることが広く認められており、かつ、実際に諸外国の政府統計に使用されている手法をいう。
- (2) 「手法の継続的な使用」は、季節調整値の客観性の確保の観点から、手法が恣意的に短期間で変更されることを防ぐために規定したものであり、より適切な手法の導入に関する検討を妨げるものではない。

3 「2 季節調整法の適用に関する公表事項」について

(1) 季節調整法の運用に関する情報

ア 季節調整法の運用に関する情報の公表方法として規定している「その他の適切な方法」とは、例えば紙媒体の刊行物等の広く一般に入手可能な媒体へ当該情報を掲載して公表することを想定している。

イ 季節調整法の運用に関する情報の公表に当たっては、近年、経済のグローバル化により、諸外国においても我が国の季節調整値への関心が高まっているものと考えられることから、日本語による公表に加え英語による公表も行うことが望ましい。

ウ 「オプション等」とは、例えば、X-12-ARIMA の場合、予測値の推計のために設定する ARIMA モデルの型式及び月中の曜日構成の相違によって生じる変動や経済政策の変更に伴う変動を調整するために設定する回帰変数等をいう。

エ 「オプション等の設定内容及び設定理由」における「設定理由」とは、例えば、AIC 値等の統計量や MPD 値等の安定性の尺度、スペクトル分析の結果等により、最適と考えられるオプション等を設定したなどの具体的理由をいう。

オ 「オプション等の見直しの頻度及び時期」の公表は、季節調整値の公表時において、オプション等の見直しについて想定している頻度等を公表することを求めるものであり、必要に応じて臨時的にオプション等の見直しを行うことを妨げるものではない。

カ 「その他参考となるべき事項」とは、例えば、手法に関するプログラムのバージョン、オプション等の設定内容をプログラムに組み込むためのスペックファイル、オプション等の設定内容の変更履歴、季節調整値を再計算する前の過去の季節調整値（改定の対象としたデータ期間分）等、本基準第2項の(1)の①から⑤までに定める公表事項以外の事項であって、利用者の利便の向上に寄与するものをいう。

(2) オプション等の設定内容について重大な変更がある場合の追加的な公表事項

ア 「オプション等の設定内容について重大な変更がある場合」とは、大規模な景気変動等が生じた場合、これが季節調整値に影響しないよう、それまでにはない新たな視点から回帰変数を組み込む場合を想定している。なお、定期的な季節調整値の改定時における一般的なオプション等の設定内容の変更は含まない。

イ 「変更の影響」の例示として挙げている「変更前に公表された季節調整値と変更後の季節調整値の差異」中の「変更前に公表された季節調整値」とは、「重大な変更を行う以前の季節変動パターンを用いた既公表の季節調整値」を、また、「変更後の季節調整値」とは、「重大な変更を行う改定において、前回改定以降に新たに利用可能となった時系列データの原数値を追加し、これにより新たに推計した季節変動パターンを用いて再計算した季節調整値」をいう。

4 「3 手法を変更した場合の公表事項について」

変更の影響の公表時期について、本基準第3項では事前公表としている。これは、手法を変更した場合、季節調整値の動きに大きな変化をもたらす可能性があるため、その利用者が適切に経済情勢の判断を行うに当たっては、季節調整値の公表以前に、あらかじめ変更内容や変更理由及び旧手法による季節調整値と新手法による季節調整値との差異等の変更の影響に関する情報を把握し、新手法の内容や変更の影響に関する理解を深めておく必要があることによる。このため、可能な限り、利用者が理解しやすい形で変更内容等を公表することが重要である。