

第 10 回 統計基準部会 議事録

内閣府統計委員会担当室

第 10 回 統計基準部会
議事次第

日 時：平成 23 年 2 月 3 日（木）12:59～14:07

場 所：総務省第二庁舎 6 階特別会議室

議 事

- (1) 「季節調整法の適用に当たっての統計基準」の設定について
- (2) その他

山本部会長 それでは、全員お集まりのようなので、定刻より若干早目ですけれども、ただいまから「第10回統計基準部会」を開催いたします。

私は、統計委員会委員で本部会の部会長を務めさせていただく日本大学の山本と申します。よろしくお願いいたします。

委員、専門委員、審議協力者の皆様におかれましては、御出席いただき、ありがとうございます。

本日の審議案件は、「季節調整法の適用に当たっての統計基準」の設定についてです。

審議をお願いします委員及び専門委員については、お手元に参考4として名簿をお配りしていますが、名簿の順に一言、自己紹介をお願いしたいと思います。

では、名簿に従って、井伊先生からお願いします。

井伊委員 一橋大学の井伊でございます。よろしくお願いいたします。

椿委員 統計数理研究所の椿と申します。よろしくお願いいたします。

宇南山専門委員 神戸大学の宇南山です。よろしくお願いいたします。

西郷専門委員 早稲田大学の西郷と申します。よろしくお願いいたします。

山本部会長 また、審議協力者として、関係府省、地方公共団体からも御参加いただいていますので、座席順に一言、自己紹介をお願いいたします。

内閣府経済社会総合研究所 内閣府経済社会総合研究所の肥高と申します。よろしくお願いいたします。

総務省統計局 総務省統計局の長尾と言います。よろしくお願いいたします。

財務省大臣官房総合政策課 財務省総合政策課・久保田と申します。よろしくお願いいたします。

厚生労働省統計情報部 厚生労働省大臣官房統計情報部の中島と申します。よろしくお願いいたします。

農林水産省統計部 農林水産省、本日は神崎課長補佐の方が所用によりまして、代理出席させていただいております有光と申します。よろしくお願いいたします。

経済産業省調査統計部 経済産業省の補佐をしております間中と申します。よろしくお願いいたします。

国土交通省総合政策局 国土交通省の大熊です。よろしくお願いいたします。

日本銀行調査統計局 日本銀行調査統計局の萩野と申します。お願いいたします。

東京都 東京都産業統計課長・大野でございます。どうぞよろしくお願いいたします。

埼玉県 埼玉県統計課長の秋葉でございます。よろしくお願いいたします。

山本部会長 では、続いて事務局にも自己紹介をお願いいたします。

杉山統計委員会担当室参事官 統計委員会担当室の杉山でございます。よろしくお願いいたします。

佐藤統計審査官 総務省の担当審査官の佐藤です。よろしくお願いいたします。

事務局 同じく総務省・吉田でございます。よろしくお願いいたします。

事務局 総務省の金子と申します。よろしくお願いいたします。

事務局 同じく総務省の川原と申します。よろしくお願いいたします。

事務局 同じく総務省の剣持です。よろしくお願いいたします。

山本部長 なお、統計委員会第1条第5条に基づき、椿委員に部長代理をお願いしておりますが、引き続きよろしくお願いいたします。

審議に入ります前に、まず本日の配付資料について、事務局から説明をお願いします。

事務局 それでは、お手元に3つの束をお配りしているかと思えます。それぞれ右上に資料1、資料2、参考資料と記載してございます。

資料1でございますけれども、先日開催されました統計委員会におきまして、諮問第35号ということで、「季節調整法の適用に当たっての統計基準」の設定についてということで、総務大臣から統計委員会に諮問された際の資料でございます。

資料2でございますけれども、これは本日の部会で、その諮問内容について御審議いただいた結果を、統計委員会の答申案という形でおまとめいただくわけですが、その原案でございます。

参考資料につきましては、審議の参考ということで付けさせていただいております。

資料は以上3点でございますけれども、不足などございましたらお知らせ願えればと思っております。

以上でございます。

山本部長 よろしいでしょうか。

(「はい」と声あり)

山本部長 それでは、審議に入らせていただきます。

まず、1月26日の第42回統計委員会において総務大臣から諮問された「季節調整法の適用に当たっての統計基準」の設定に関し、その概要について事務局から説明をお願いします。

佐藤統計審査官 私の方から説明させていただきます。お手元の資料1と、3つ目のホチキスどめをしてある参考資料を適宜参照しながら説明させていただきます。

まず、資料1を1枚めくっていただきまして、諮問の概要と書いてあるペーパーがございます。諮問の概要につきましては、今回、統計基準案としてお示しする内容の、いろいろな周辺情報や考え方をまとめたペーパーでございます。

簡単に説明させていただきますと、季節調整法の適用に当たっての統計基準の目的と書いてございますが、一般的な考え方として、なぜ季節調整法の適用に当たって、中身は説明しておりませんが、何らかの統計基準が必要なのかということについて述べたのが1でございます。

第1段落でございますが、なぜ世の中で季節調整をするのかということが書いてありまして、時系列データの短期的な動向を把握するに当たっては、季節的な変動要因を除くことによって短期的な動向の把握が可能になるということが多いということで、季節調整が

世の中で行われているということでございます。

第2パラグラフとしまして、実際の季節調整に当たってはいろいろなやり方がございますけれども、現状、日本の場合は、アメリカのセンサス局が開発したX-12-ARIMAですけれども、X-12と言わせていただきます。X-12プログラムに基づいてやっている場合が多いということでございます。

その中で、X-12はデータの性質に応じていろいろなオプション等を設定することになっております。そもそもオプションを含めて、どのような手法が使われていて、その中身がどういうふうになっていて、オプションをどういうふうに設定しているかという情報がないと、季節調整というのはある意味数理的な処理でございますので、ユーザーが評価するに当たっては情報が必要であるということで、そのような情報がきちんと開示されている必要があるということ、第2、第3パラで書いてございます。

そういう情報の公表といいましょうか、開示の必要性が季節調整値を使う側にとって非常に重要なことであるということで、そのような情報をきちんと、どのような内容かということも含めまして公表することの基準を設けることは、今回、季節調整法の適用に当たっての統計基準として定めることが、一般論として適当ではないかと考えた次第でございます。

2は実際の統計基準というのは、統計法の中で言う新たな概念でございますけれども、参考資料の3ページ目、参考3に書いてございますけれども、今回、新しい統計法の中でできた概念というか、考え方というか、決まりといいましょうか、参考が別になっていて恐縮でございますけれども、3ページ目でございます。

統計法の抜粋を書いておりますので、適時参照していただきたいと思っておりますけれども、公的統計の作成に際して、統一性または総合性を確保するための技術的な基準ということでございます。

またもとに戻りまして、諮問の概要の2でございます。そういう統計基準という新たな概念ができたわけですが、実は季節調整法の適用に当たっては、参考資料の1ページ目にありますとおり、もともと平成9年にいろいろな情報をきちんと公開してくださいという、1で述べたような趣旨の観点から、季節調整法の適用についての指針というものを、当時の統計審議会です承した内容に基づいて、政府の中で運用してきたという実態がございます。

そのような実態を踏まえて、先ほど申した統計基準という新しいスキームができましたので、それらの状況変化、それから公的統計の基本計画の中での記述等、指摘等を踏まえまして、統計基準という統計法に基づくスキームの中で定めるのが適当ではないかと考えたということでございます。

3としまして、先ほど参考資料の1ページ目で平成9年の指針をお示したところでございますが、るる申し上げましたが、平成9年の内容を参考にしつつ、今回、統計基準の具体的内容としては、季節調整法の運用に関するその後の状況の変化を踏まえまして、そ

ここに、と書いてございますが、季節調整値の利用者の利便の向上ということで、公開する情報の充実を図るということでございます。

それから、情報通信環境、具体的に言うとインターネット環境が広く皆さんに受け入れられているという状況を踏まえまして、そのような観点から必要な変更を行った内容を新たに統計基準として定めてはどうかということで、具体的な内容を事務局の方で提案させていただいている次第でございます。

具体的な内容が別紙、3ページ目に書いてございます。これをそのままやるよりは、1枚めくっていただいて、横書きのペーパーに、平成9年の指針と、今回、事務局の方から提案させていただいている新たな統計基準案というのを比較検討できるような形にしておりますので、それに基づいて具体的な案を説明させていただきたいと思います。

1については、平成9年の指針と新しい案ということでございますが、今回、国際比較等の観点からも重要だろうということで、「国際的に」という文言を新たに加えています。

それから、文章技術的なこともあります。例示等を括弧書きとして整理しまして、全体を簡潔に整理し直したところでございます。

あと、平成9年の指針の2、3、4については、どのような情報を公表するかというのをいろいろ書いてございます。これは、文章が箇条書き等になっておらず、読んですぐに理解するのはなかなか難しいということも技術的にありますので、新たな基準案としましては、2の(1)としまして、からまで箇条書きにしてわかりやすく整理したということでございます。

それから、平成9年の指針の4の中に、報告書等に情報を記載してくださいと書いてあります。それについては、2の(1)の先頭に書いてありますように、情報通信環境の情報伝達手段の発達といいたいまいしょうか、それを踏まえてインターネット等、適切な方法により公表するというので書き直しているということでございます。

それから、からについては、平成9年の指針の2、3、4の中に書かれているものを整理して書き直しましたということでございます。

それから、新たな基準の2の(2)と3についてでございますが、これは平成9年の指針の中では明示的に書かれていなかったことでございますが、2の(2)としまして、オプション等の設定内容で重大な変更がある場合は、変更の影響を季節調整値とともに公表してくださいと。

それから、手法を変更する場合にも、事前に変更内容、変更理由、変更の影響について公表してくださいということを明示的に新たに書き加えて、利用者の利便の向上を図っているということでございます。

それから、平成9年の指針にあった5については、世の中の情報伝達手段としましては、リアルタイムにいろいろなことが変われば、季節調整等を行っている各統計作成者のもとで、ホームページで情報が発信されるだろうという実態を踏まえまして、5についてはそういうものがなかった時代の書きぶりかなと思いますので、今回、削除したということで

ございます。

そのような平成9年の指針に基づいて、必要な変更を行ったのが統計基準の新たな案でございまして、これについて皆様に議論をしていただきまして、最終的な結論を得ていただければありがたく思います。

山本部会長 ありがとうございます。

それでは、まず季節調整法の適用に当たっての統計基準の設定の必要性、及び諮問された基準案の各事項の適否について、順次、各メンバーの皆様方から御質問、御意見をいただきたいと思っております。

まず、統計基準としての設定の必要性については、いかがでしょうか。これは、今、説明があった諮問の概要の1と2に当たるところだと思っておりますが、統計基準として設定する必要があるかどうかということについて議論していただきたいと思っておりますけれども、何か御意見がありますでしょうか。必要性とか目的、理由について、何か。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 特になければ、統計基準としての設定の必要性については、認められたということにしたいと思っております。この諮問の概要1及び2のとおりということにしたいと思っております。

次は、具体的に統計基準案の各事項ですね。別添2にある一番左側のカラムの1、2、3を順番に議論していただきたいと思っておりますが、まず最初は、一番上にあります「1 季節調整法を適用する場合の手法」というところについて、何か御意見ありますでしょうか。

椿委員 私、基本的にはこの考え方でよろしいと思っております。ただ、今回、例えば「X-12-ARIMA等」という形で例示があって、X-12-ARIMAというのはノウハウをかなり必要とするものであって、今の時点で妥当性を申し上げることではないと思っておりますけれども、公表事項に関していろいろなオプションや何かに対しての透明性というのが出てくる。これも全くそのとおりであるかと思っております。

一方で、多分、これは今回の諮問とは、特に基準とは直接関係ないのかもしれませんがけれども、今後の方向性としては、できるだけむしろオプションといいますか、ノウハウで調整していくというよりは、モデルベースといいますか、例えば状態空間法とか、そういうもの。あるいはそれに対して、ある程度季節性自体が変動することを許容するような統計モデルというものがあると思っております。

アカデミアの中で見えてきている話と、実務の中で使う話の間には、まだまだ距離はあるのかもしれませんが、その種のものに対する、日本だけじゃなくて各国の統計に関係するんだと思っておりますけれども、そういう部局がその種の研究動向を十分キャッチしていただいて、将来的な今、統計関係の者が割と注目しているようなモデリングに基づく方法論のようなものが認められるような素地をつくっていただければと思っております。

一応、これは諮問に対するというよりも、そういう感触を持ったということで、デファクトスタンダードとして確立しているものを使うのは当然なのですが、そういうこ

とをちょっと申し上げさせていただきます。

山本部長 ありがとうございます。

ほかには何か御意見ございますでしょうか。

井伊委員 それに関連して。統計委員会の本委員会で季節調整法の適用についての指針ということで、ここでは「X-12-ARIMA 等」となっているのですけれども、指針の方では具体的に、多分昔のものだと思いますけれども、X-11 とか DECOMP が出ております。私も理論的なことはわかりませんが、ほかにも TRAMO-SEATS と言いましたか、ユーロスタットで。

私、社会保障の専門なのですが、ユーロスタットのような、各国共同でできるだけ基準を統一していくような努力をしているところで、非常に評価が高いものもありますし、この「等」というところを、前、統計委員会でいただいたような指針のような形で具体的にお書きになることが可能なかどうか。以前いただいた資料では出ていたのですが、ここでは省略されておりますので、その辺りを説明していただけたらと思います。

山本部長 X-12 以外にも何か列記した方がいいという御意見でしょうか。

井伊委員 以前、統計委員会でいただいた資料には書いてありました。

山本部長 平成9年の指針の前文みたいなところでしょうか。

佐藤統計審査官 今、お配りしている参考資料の参考1という1ページ目に。統計委員会から基本的な資料の中身は変わっておりません。そこを見ていただくとよろしいのかと思いました。

山本部長 ほかにはどうですか。

井伊委員 そうですね。今日の参考資料に。

佐藤統計審査官 本委員会と資料の付け方が変わっていて、大変恐縮でございますけれども。

山本部長 実は、私も井伊さんに多少近い感じを抱いておりまして、X-12-ARIMA は非常に広く使われている方法ですけれども、基準としては、これは一度制定されれば、非常に長く将来にわたっても使われる可能性があるので、将来にどういう方向に行くのかというのを示すということも重要ではないかと考えています。井伊さんが言われたように、TRAMO-SEATS という手法がヨーロッパの方で、すべての国ではないと思いますが、使われているわけです。

その発想は、X-12-ARIMA は完全に恣意的なフィルターというか、経験フィルターであり、余り理論的根拠がないのです。結果的にはうまくいっているわけですがけれども、TRAMO-SEATS は部分的にウィナー・コルモゴロフのシグナル・エクストラクション（信号抽出）という理論を使って、多少理論的になっているわけですね。そういう意味では、多少理論的な方が今後の方向かなと思います。更に、理論モデリングという方向に進むとすれば、先ほど椿先生が言われた状態空間表現を用いた手法というのが、理論的にある種完結された方法だと思います。

それには、統数研が開発している DECOMP とか、ハーヴェイがやっている STAMP というの

があると思います。そういう手法も将来を考えたら少し言及しておいた方がよいと思います。この X-12 は、今は広く普及しているわけですがけれども、基準がずっと長く使われていくと、やがてだんだんアウト・オブ・デートになっていった時に、少し問題かと思えますし、基準としては将来どういう方向に進むかというのをちょっと示しておいた方がいいかなと感じています。そういうふうにくつつかの手法を併記することに関しては、基準としてはどういうふう考えたらいいんでしょうか。

佐藤統計審査官 非常に実務的な観点からコメントさせていただきますと、我々としては先ほどの樁先生のコメントも含めまして、ちょっと前置きが長くなりますけれども、不十分なところもあるかもしれませんが、いろいろな手法をウオッチ、今までもやっておりますし、引き続きやっていきたいと思っておりますし、例えば世界的にも実務的にどんな方法が使われているかというのをウオッチしていきたいと思っております。

そういうことを前提としまして、先生方から今、いただいたことに基づいてお答えしますと、まず先ほどの基準案としまして、別添 2 の一番左側、最後の括弧書きの例示について、皆さん、ここはどうなのかというお話だったかと思えます。それにつきまして、文書技術的な観点から言いますと、どこまで例示するのが適当なのかとか。例えば、全部挙げてしまうと、それ以外、もう選択肢がないみたいな形になってしまいますし。

あと、TRAMO-SEATS 等については、我々が調べた範囲では、ヨーロッパで使われていて、ユーロスタットのマニュアルでは、X-12 か TRAMO-SEATS か、どっちか自分たちでよく研究して使ってくださいということで、実態としては、イギリスとかドイツについては TRAMO-SEATS は全然やっていない。フランスが両方使っているとか、あと南欧において TRAMO-SEATS が結構使われている状況がございます。

そういう状況を勘案して、我々の気持ちとしては、今後の動向も考えると、余りここにいっぱい例示を書くよりは、実務的に使われているもの、主に使われているものを今のところは 1 つ書いておきまして、リマークとしましては、基準というよりは、基準の運用に当たって、各省へ事務局として示すような文章とかも今後考えないといけないと考えているところがございますので、そういう中で言及していった方が、運用としては実務的にはやりやすいのかなと思う次第でございます。

先生方が指摘された考え方自体は、全然否定するものではなくて、実務上の運用的な観点から、そういう形にさせていただくことが、事務局としては一番ありがたいなと思えます。

山本部長 今回の事務局の考え方に対して、委員の方、何か御意見ありますでしょうか。

西郷専門委員 事前に御説明いただいたときに、私は、もし 1 つだけ挙げるとすれば X-12-ARIMA を挙げておくのが適切ではないかと申し上げたんですけれども、逆に今、山本部長あるいは樁委員、井伊委員の方から、理論的な観点から考えて、経験的な手法のみがここで例示されているというのは、少し将来的な方向を考えると心配であるというコメントをいただいたわけです。

繰り返しになるかもしれませんが、もしそういう強い理論的な理由があるのであれば、例えば3つぐらい挙げておいて、一番最後に「等」と付けておけば、別にこれだけじゃないぞという意味も加わるわけで、何で例示が1つならいいけれども、3つならだめであるという、その理屈が私、ちょっとのみ込めないで、御説明いただけるでしょうか。

佐藤統計審査官 私の説明があいまいなところがあったのかもしれませんが。例えば我々の認識だと、今、国際的に認知されている手法としては、我々の把握する範囲は、X-12と、その中にX-11もサブセットとして含まれていると思います。あと、TRAMO-SEATSというのが、公的統計では国際的に実務的に使われていますと。あと、プラス、統計数理研究所のDECOMPとか、手法としては、先ほど理論的にこういうのがあるというのが、世の中には知られているところだと思います。

ですから、基本的には3つしかないのかなというのが我々の認識で、その3つがあったときに、3つ書いてしまうと、文章技術的には、3つしかないのに、それに「等」を付けるというのは、これは総務大臣の決定事項として官報に告示することを予定しておりますけれども、3つしかないのに、それに「等」を付けるというのは、細かい話かもしれませんが、ちょっと付けられないなという認識が1つございます。

あと、3つがだめなら、2つなのか、1つなのかと、いろいろな議論が起こるので、そこはちょっと申しわけないですけれども、実務的に使われているものを1つ書くのが、一番収まりとしてはいいのかなと。そういうこともあって、今後の方向性というお話がありましたけれども、政府の中で留意すべき事項等については、簡潔性及び誤解のないように書くことを前提とした、基準案の本文というよりは、いろいろな解釈とか運用に当たっての留意点みたいなものの中で述べていくのが、実務的には一番ありがたいなと思った次第でございます。

山本部会長 何か御意見ありますでしょうか。

今、おっしゃられた運用についての留意点というのは、実際に書かれて配付されるということでしょうか。

佐藤統計審査官 今のところ、具体案をつくっているわけではございませんが、例えば物価指数の基準時について、1年前にこの場でも御議論いただきましたけれども、そういうものについては、解釈・運用等について誤解のないように、実際問題として総務省が各省に通知文を出しましたので、そういう中で考えていくことは可能かと思っております。

山本部会長 そういう意味では、一つの代替案としては、ここには書かないけれども、運用のところに例えば「X-12-ARIMA等」とはどういう意味かということ、他にも季節調整法としてTRAMO-SEATS及びDECOMPがあると、そういう文章が入り得ると理解していいんでしょうか。

佐藤統計審査官 そのとおりです。

山本部会長 ここで基準の第1項目に具体的に入れるか、あるいはそういう運用の方で明示的に取り上げるかという代替案があるわけですがけれども、その辺については委員の方

はどういうふうにお考えになりますでしょうか。今までの議論に関連して。

宇南山専門委員 逆に、例示なしというのは考えられないのでしょうか。

佐藤統計審査官 それも事務的にはいろいろ検討したのですけれども、さすがにこれは国会で審議していただく法案そのものではございませんが、法案の事例等を見ると、何らかの具体的なものがわかるように書くというのが通例でございますので、結局そのバランス論ということで1つ入れたということがございます。

山本部会長 例示なしにして、運用の方に3つ並べると、委員会サイドのアイデアとしてはかなりすっきりするという感じは受けますけれども、どうですか。例示なしはなかなか難しいのでしょうか。慣例というか。

佐藤統計審査官 難しいというか、どこかにそういう決まりが明示されているわけではないのですけれども、俗な言い方ですけれども、収まりのいいように書かせていただいたということなのですが。たかが例示されど例示ということで、我々もいろいろ考えた末、こういうふうにしてはどうかと考えました。

西郷専門委員 例えばX-12-ARIMAというのがもう主流でなくなったときには、この基準は書き換えなければいけないということになってしまうんですか。もうだれもこんなものは使っていないというような、10年後ぐらいのとき。だとすれば、宇南山委員がおっしゃったように、具体的な手法というものはむしろ載せずに、運用の方でそれを適宜変えていくというのが合理的な選択肢になり得ると思うんですけれども。

佐藤統計審査官 いろいろ考え方があるかと思えます。全くX-12が使われなくなったら、書き換えないといけないかなという気がしますが、実務的には10年でそこまで行くのかなという、何も根拠はございませんけれども。X-11も多分30年近く、実態としては使われていると思います。X-12が日本で使われるようになって、まだ10年ちょっとだと思えます。ヨーロッパには、いまだX-11をメインにしている国も、IMFのホームページを見るとそういうところもあったりするようでございますので。

全く例示を挙げないというのはいかがなものかという議論もあり、挙げると10年後はどうなるんだという議論もありますけれども、どちらをとるかということで、こういうふうになっているという。ちょっと堂々めぐりかもしれません。

山本部会長 委員の方から追加的な御意見、ありますでしょうか。

余り僕も固執する気はないので、運用の方にこの3種の方法を併記していただく。そういうところで納得してもいいかなと思っていますけれども、どうでしょうか。

椿委員 先ほどのところにそういう例示があるのでしたら、基準案のところ自体は、どれか1つを残せといたら、例えばX-12-ARIMAがデファクトスタンダード、当面シェアが最大であるという意味でよろしいんじゃないかと思えます。

私の最初の発言というのは、どちらかという季節性というものが非常に不安定化している現状から、幾つかの方法論に対してウオッチしておかないと危ないだろう。そのときに、ある種のモデルが明確に意識できるものは、一つの規範になるのではないかというこ

とで。

これは、公的統計の中で何を基準とするかということと同時に、いろいろな方法論の間の比較は別途余裕がある限り、やっておかれたらどうかというぐらいの感覚ですので、是非そういう形で研究的なことも、この分野は非常に重要だと思いますので、政府の部局の方でよろしくお願ひしたいということでございます。

山本部会長 わかりました。

では、ほかの先生、いかがでしょうか。私もその方向でよいのではないかと考えております。であれば、別に事務局サイドとしては問題ないということでもよろしいですか。

佐藤統計審査官 はい。あと、椿先生がおっしゃった政府の勉強というか、動向を把握するよというお話については、また統計委員会の報告とかできちんと対応したいと思ひます。

山本部会長 是非、よろしくお願ひします。では、この第1項については原案どおり承認し、運用の方で他にも TRAMO-SEATS とか DECOMP もあると明示していただくということにしたいと思ひます。

それでは、項目2の季節調整法の適用に関する公表事項の(1)については、何か御意見ありますでしょうか。(2)も含めてもよろしいですけれども、何か御意見ありますか。どうぞ。

井伊委員 公表の時期についてお伺ひしたいんですが、余り頻繁に行うと恣意性が疑われてしまうこともあると思うので、定期的・定例的に行うべきだと思うんですが、その辺りはどのように事務局の方でお考えでしょうか。もちろんリーマン・ショックのような明らかな構造変化があったときには、臨時の改定というのもやむを得ないと思ひますので、ウェブなどで周知徹底するとか情報開示することになりますが、基本的には定期的に行われるべきだと思うのですが、時期についてお聞かせいただければと思ひます。

佐藤統計審査官 政府の実態といひますしょうか、多分井伊先生が言われた趣旨は、手法を変えるというのは、X-12から TRAMO-SEATS に変えるとか、DECOMP に変えるというのは、今まで世の中に事例がないので、今後のことかと思ひます。ただ、今、先生が言われたのは、例えば運用するに当たって、同じ手法、X-12 を使ったとしても、オプションを変えたり、そういう事例の方で答えさせていただきます。

具体的には、政府の実態を調べたところ、いろいろなパターンがあるんですが、例えば季節変動というのは、過去のデータを基に1年間固定しているという運用をしているところがかかなり多うございます。そういうところでは、1年に1回、例えば年末までのデータがそろったところでオプションを見直すということ、今、実態としてやっております、そういう情報をきちんと開示しているところでございますので、基準(案)2の(1)の
でございますけれども、オプション等の見直しの頻度とか時期ということでも明示するよ
うにしております。

そういう観点から、今、井伊先生の御質問に答えるとすれば、そうなっておりますので、

そういう形で見れば、恣意性とかは排除されるのではないかと思う次第でございます。論点がずれていましたら、御指摘ください。

山本部会長 いかがでしょうか。

井伊委員 結構です。

山本部会長 ほかに項目全体について何か御質問ありますか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 では、項目2について、委員の方からそれ以上の質問がないので、項目3、手法を変更した場合の公表事項について何か御意見ありますかでしょうか。特に御意見がないということになると、これで基本的には原案をお認めいただけることになると思いますが、けれども。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 そこで、基本的に項目1については、留意事項があるという状況でありませけれども、諮問に関しては原案どおりですので、そこで答申案の審議という方に移らせていただきたいと思えます。

まず、私と事務局で相談して、資料2として準備しました答申案の全体構成について説明いたします。

最初に前文を記載しております。前文は、総務大臣が「季節調整法の適用に当たっての統計基準」を設定するに当たり、その適否について総務大臣から統計委員会に意見を求められたことに対し、統計委員会として答申を行うものであることを記載したものです。

前文の下に「1 設定の適否」と「2 理由」を記載しています。

「1 設定の適否」においては、「季節調整法の適用に当たっての統計基準」の設定に関する全体的な結論を、また「2 理由」においては、1の結論に至った理由を記載しています。

それでは、まず事務局から項目2の事項ごとに朗読を行い、その後、順次、御検討いただきたいと思えます。なお、項目1の設定の適否は、項目2の個別事項の検討を行っていただいた後で確認したいと思えます。

それでは、朗読をお願いしたいと思います。

事務局 それでは、項目2の理由の(1)を読み上げたいと思えます。

(1) 統計基準としての設定

経済時系列データへの季節調整法の適用に当たり、適切性が評価されていない手法の使用や、手法の頻繁な変更が行われた場合、季節調整値を用いた経済動向の判断が困難となる。また、季節調整法の運用に関する情報(オプション等の設定内容等)が公表されず季節調整値の客観性が確保されない場合、経済時系列データの季節調整値による動向判断や、複数の経済時系列データの季節調整値を用いた総合的な判断が困難となる。

こうしたことから、平成9年に統計審議会が了承した「季節調整法の適用について(指針)」において、適切な手法の継続的使用や、季節調整法の運用に関する情報の公表等

が季節調整法の適用に関する実務上の指針として示され、これに沿って、公的統計の分野において各経済時系列データの季節調整が行われてきており、これまで指針は有効に機能してきたところである。

こうした状況に鑑みると、季節調整値について、その客観性の確保を図るとともに、統一性及び総合性の確保を図る観点から、季節調整法を適用する場合の手法や運用に関する情報の公表事項等に係る基準を設けることが必要である。

さらに、平成 19 年に全部改正された統計法（平成 19 年法律第 53 号）においては、新たに、公的統計の作成に係る幅広い各種の技術的基準として「統計基準」を設定することが可能となり、このため、「公的統計の整備に関する基本的な計画」（平成 21 年 3 月 13 日閣議決定）においても、季節調整法の適用に当たっての基準を新たな統計基準として設定することとされているところである。

したがって、季節調整法の適用に当たっての統計基準を、統計法第 2 条第 9 項に規定する統計基準として設定することは適当である。

以上です。

山本部長 では、今、朗読いただいた 2 の（ 1 ）統計基準としての設定について、いかがでしょうか。これでよろしいでしょうか。

（「異議なし」と声あり）

山本部長 では、2 の（ 1 ）統計基準としての設定については、これで御了承いただいたものとします。

では、次をお願いします。

事務局 （ 2 ）諮問案の内容

諮問案は、これまで有効に機能してきた平成 9 年の統計審議会指針をおおむね踏襲した内容となっていること、利用者の利便の向上を図るとともに、情報通信環境の変化に対応するため、当該指針に必要な変更を行ったものであることから、適当である。

項目ごとにその内容を評価すると、以下のとおりである。

ア 季節調整法を適用する場合の手法

季節調整法を適用する場合は、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を継続的に使用することとしている。これについては、次の理由から適当である。

経済時系列データの季節調整を、国際比較可能性を確保しつつ適切に行うためには、理論上及び実務上、適切な方法であることが国際的に広く認められている手法を使用する必要があること。

手法を継続して使用することについては、経済時系列データの季節調整における恣意性を排除し、季節調整値の客観性の確保に寄与するものであること。

山本部長 今、（ 2 ）のアの項目まで行ったわけですが、これについて何か御意見ありますで

しょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 なければ御了承いただいたということで、次に。

事務局 イ 季節調整法の適用に関する公表事項

(ア) 季節調整法の運用に関する情報

季節調整法の適用に当たっては、手法の名称、推計に使用するデータ期間、オプション等の設定内容及び設定理由等の運用に関する情報を、季節調整値と併せて公表することとしている。

これについては、季節調整では、同一の経済時系列データに同一の手法を用いたとしても、推計に使用するデータ期間やオプション等の設定内容が異なれば算出される季節調整値は異なったものとなるため、季節調整値の利用者において、経済時系列データの季節調査値による動向判断や複数の経済時系列データの季節調整値を用いた総合的な判断を行う際には当該情報が必要であることから、適当である。

山本部会長 では、(2)のイの(ア)季節調整法の適用に関する公表事項のうち、季節調整法の運用に関する情報というところまでですが、何か御意見ありませんでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 特に御意見がないようですので、原案どおり御了承いただいたものと思います。

では、次を。

事務局 (イ) 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

オプション等の設定内容について重大な変更があるときは、上記(ア)の運用に関する情報に加えて、当該変更の影響も公表することとしている。

これについては、オプション等の設定内容の重大な変更は、季節調整値の動きに変化を生じさせ経済情勢の判断に影響を及ぼす可能性があるため、その利用者が適切に当該判断を行う際には、公表済みの季節調整値とオプション等変更後の季節調整値との差異等の変更の影響に関する情報が必要であることから、適当である。

山本部会長 ありがとうございます。今はイの(イ)で、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について朗読していただきましたが、何か御意見ありませんでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 特に御意見ないので、原案どおりで御了承いただいたものと思います。

事務局 では、ウ 手法を変更した場合の公表事項

適用している手法を変更するときは、あらかじめ、変更内容、変更理由及び変更の影響を公表することとしている。

これについては、手法の変更は、季節調整値の動きに大きな変化をもたらす経済情勢の判断に「オプション等の設定内容に重大な変更がある場合」以上の大きな影響を及ぼす可能性があるため、その利用者が適切に当該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から、適当である。

山本部会長 ありがとうございます。今は、ウ 手法を変更した場合の公表事項の項目ですが、これについて何か御意見ありますでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 特に御意見ないようですので、原案どおり御了承いただいたものといたします。

事務局 最後、エ 季節調整法の運用に関する情報等の公表方法

季節調整法の運用に関する情報や手法を変更した場合の変更の影響等の事項の公表方法については、インターネットの利用その他の適切な方法によることとしている。

これについては、近年の経済動向の急速な変化への対応の観点から、季節調整値の利用者に対する当該情報等の迅速な提供が必要であることから、適当である。

山本部会長 ありがとうございます。今はエ 季節調整法の運用に関する情報等の公表方法という項目を御朗読いただきましたけれども、何か御意見ありますでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 では、特に御意見ないようですので、原案どおり御了承いただいたこととしたいと思います。

「2 理由」の各項目について審議いただいて、すべて御了承いただいたということで、それでは資料2の1ページの「1 設定の適否」について御検討いただきたいと思います。

ここでは、季節調整法の適用に当たって、統計基準については諮問案により、統計法第28条第1項に基づき統計基準として設定することは差し支えないと記載していますが、これを本部会の審議の結論とすることについて御異議ございますでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 特に御異議がないようなので、了承とさせていただきたいと思います。

これで答申案については、すべて御検討いただきましたので、審議結果をまとめさせていただきたいと思います。

本部会として、答申案について御了承いただいたということでよろしいでしょうか。

(「異議なし」と声あり)

山本部会長 ありがとうございます。それでは了承とさせていただきます。

御了承いただきました答申案につきましては、2月24日開催予定の統計委員会におきまして、本日の部会の議事概要とともに私から報告することといたします。なお、議事概要については、事務局から事前に照会いたしますので、御対応をよろしくお願いいたします。

以上をもちまして今回の諮問に関する審議は終了したということにさせていただきます。

それでは、せっかくの機会でもありますので、委員、専門委員の皆様において、季節調整法の適用に関する御意見、御要望があればお示しいただき、関係府省から御説明いただくと思います。何か御意見、御要望があれば自由に御発言いただきたいと思います、いかがでしょうか。

井伊委員 私自身は、時系列のこういったものは使いませんので、周りの特に民間のエコノミストたちと話したときに、再現可能性が大切だということなんですが、今回、公表されることによって、季節調整値の再現可能性というものがかなり保たれることになるのか、その辺りに非常に関心があります。今回、統計基準として設定して公表することのすばらしい点だと思いますので、その辺り、かなり要望が強いようなので。

佐藤統計審査官 現状でも、情報については平成9年の指針に基づいてやっておられると思います。それを丹念に読めば、再現可能だと事務局は認識しておるんですけども、エコノミストの方の細かい御要望を必ずしも把握していないので恐縮でございますけれども、そういう実態を踏まえたと、今回、わかりやすく書いておりますので、利用者の方の認識が深まれば、再現可能性は今までと同様にあると考えております。

山本部会長 ほかに何か御意見ありますでしょうか。

先ほど椿先生の方から、そういうこれからの方向性で研究を続けてほしいという御意見がありましたけれども、実際に現状として X-12-ARIMA 以外にいろいろ試みている省庁というのはあるのでしょうか。

佐藤統計審査官 各省さん、任意で手を挙げていただければと思いますが、私の知る限り、ホームページ上で公開している情報としては、内閣府さんで TRAMO-SEATS 等を研究した論文を載せていらっしゃる。ただ、具体的にこれをやったことによって、このぐらい変わったので移行すべきという話ではなくて、技術的な観点から研究された成果があると聞いております。

それから、総務省さんにおいても、ホームページには載っていないみたいですが、一般に配っている本の中でも TRAMO-SEATS について技術的な研究をされて、実験的なデータを見る限り、余り変わりませんでしたということをやられていると聞いております。

ほかに各省さんで何か任意に情報提供できる場所があったら、やっていただければと思います。

先ほどの椿先生の御指摘については、政府の中できちんといろいろ研究するようにという御指摘でございましたので、どういう形がいいか、目に見えるようにするにはどういうふうにしたらいいか、また具体案を検討したいと思います。

山本部会長 検討を是非進めていただきたいと思います。よろしくお願いします。ほかには何か御意見ないでしょうか。

西郷専門委員 終わりかけているところで申しわけないですけども、今の椿委員の御意見と関連することなのでですけども、将来、X-12-ARIMA からほかの方法に移るかどう

ということの一つの論点として、政府統計データの作成に当たって、モデルの使用というのをどういうふうに考えるべきなのかということがあると思います。

現状では、モデルに乗った形で統計を作成するということは余りやっていないわけですが、翻ってモデルを使わないということが、本当にモデルに依存していないかというのと、そうでもなくて、余り自分では認識していないけれども、結果的には何らかのモデルを使っている結果になっていることが多いように思います。

ですから、季節調整だけに限らないのですけれども、将来的に統計を作成する技術の問題として、モデルの使用というものをどういうふうに政府の中で位置付けているのかというのが、結構重要な話題になるのではないかなと思いました。

佐藤統計審査官 事務局から1点質問させていただいてよろしいでしょうか。

今の西郷先生のお話ですが、季節調整以外の部分で何か想定されているようなことが具体的にもしあればお示しいただけますか。

西郷専門委員 小地域統計というものがございましてね。あれも一応モデルを考えて、縮小推定なりをすることになるわけですがけれども、例えば試験的に行われていることと伺っていますけれども、公表もされているようですけれども、労働力調査等で都道府県別の失業者数とか失業率を出そうとしたときに、現状の標本の設計では、そのままでは信頼できる数字が出せないわけです。

けれども、小地域統計、スモール・エリア・エステメーションというのも、一種のモデルを前提にして行われるものなので、こういうモデルがもし正しいとすれば、今のサンプルサイズでも都道府県別の失業者数といったものが出せますというときに、それを行うか、行わないか。行う場合には、このモデルの使用というのをどういうふうに考えるのかというのをきちんと表明する必要があると思うんですね。

なので、モデルを使っていいということであれば、かなりいろいろな細かい統計の需要に応えることができるようになるでしょうし、逆に余り特定のモデルに依存した推定はよろしくないということであれば、政府統計の作成者の側からその需要に応じることはできない。その代わりにミクロ統計を公表することによって、分析者の方でそういったモデルを設定して推定してくださいという格好になると思います。

そういうふうにモデルに基づいて、どれぐらいの推定をするのかということに応じて、政府統計の側でやらなければいけないことの量、それからここから先は分析者の方でやってくださいという境界というのもだんだん変わってくるように思います。なので、これは多分、季節調整はモデルの使用ということがかなり全面的に出てきますけれども、それ以外の部分でも、政府の統計の作成者がやらなければいけない限界というのがどこまでなのかというのを考える上では、とても重要な論点ではないかと思います。

山本部会長 基本的に、政府統計全体としてモデリングをどの程度取り入れていくかということをはっきりさせるのは、なかなか難しいような気がしますが。

西郷専門委員 論点としては、何かそれについて決まりをつくれということを主張して

いるわけではございません。ただし、今までは余りモデルは明示的に出てこなかったわけですけれども、今後はそれをどう考えるのかということが結構重要なのではないかと、一個人としての意見を述べたというだけです。

山本部会長 貴重な御意見、ありがとうございます。

ほかには何か御意見、ありますでしょうか。はい。

宇南山専門委員 1点だけ。今回の基準案では、継続的な使用というのが一つのポイントになると思うんですが、オプションの見直しというのがリーマン・ショックのときなどに見られるように、ある種恣意的かつ臨時的なオプションの変更などが想定されるようなケースに、オプションの変更を推奨するのか、もしくはできる限り定期の見直し以外は手を付けないという方針を出すのか、その辺の運用をするなどは言えないと思いますので、強弱について何か事務局としての御意見があれば教えていただきたい。

山本部会長 何かありますか。

佐藤統計審査官 なかなかコメントしづらいですけれども、そのときに非常に経済動向が急激に変化して、経済市場が急激に変動したときの対応についてのお話だと思いますが、そのときに経済動向が急激に変動しましたが、季節変動にそれが影響しているかどうかというのは、また別問題のような気がしますので、今回の実例などから見ますと、基本的には定期的な見直しの中でやっている実例が、やったとしてもそういう実例が多かったのかなという気がしております。

2の(1)の ということで、オプション等の見直しの頻度・時期というのをあらかじめ明示することになっておりますので、季節調整をするに当たって、経済動向は劇的に変動したけれども、季節指数自体はそれほど変動していないという前提に立てば、 の形でやっていくのかなという気がしております。

山本部会長 ありがとうございます。

ほかには何か御意見ありますでしょうか。審議協力者の方、御質問とかコメントがありましたらいただきたいんですけども。

非常に早目に終わりそうなんですけれども、本日出ました意見については、今後、各府省において季節調整に関して、あるいはより一般的なモデリングについての御意見等について、今後の参考にしていただければと思います。

それでは、本日の会議はこの辺りまでとさせていただきます。精力的に審議を行っていただいた結果、本日、答申案の了承に至りましたことについて、部会長として御出席の皆様にご礼申し上げます。ありがとうございました。

これで閉会といたします。