

第 10 回統計基準部会 議事概要

1 日 時：平成 23 年 2 月 3 日（木） 13：00～14：10

2 場 所：総務省第二庁舎 6 階特別会議室

3 出席者：

（部 会 長） 山本 拓

（委 員） 井伊 雅子、椿 広計

（専 門 委 員） 宇南山 卓、西郷 浩

（審議協力者） 内閣府、総務省、財務省、厚生労働省、農林水産省、経済産業省、
国土交通省、日本銀行、東京都、埼玉県

（事 務 局） 内閣府：杉山統計委員会担当室参事官

総務省：佐藤統計審査官ほか

4 議 題：

(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

5 審議の概要：

(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

事務局から第 42 回統計委員会（平成 23 年 1 月 26 日開催）において諮問された「季節調整法の適用に当たっての統計基準」（案）の内容について説明を行った後、審議が行われ、当該案について原案どおり了承された。委員等の主な意見等は以下のとおり。

- 統計基準案において、使用する手法の例示として X-12-ARIMA を挙げていることは、公的統計分野の経済時系列データの季節調整法の運用実態を踏まえたものであることから適当である。また、X-12-ARIMA の運用には専門的知識・技術が必要であるため、統計基準案に運用に関する情報の公表を定めていることも適切なものとする。
- 季節変動パターンが時とともに変化する状況を想定し、季節調整の手法に関する今後の方向性としては、X-12-ARIMA のようなある程度経験則に依っている手法から、理論に基づくモデルに基礎を置く手法へ移行していくべきではないか。したがって、政府は、季節調整法関係の国際的な研究動向に関する情報収集に努め、理論に基づくモデルを用いた手法の採用についても将来的には検討を行ってほしい。
- X-12-ARIMA は現在、公的統計の分野で広く使われている手法であり、これによる季節調整の結果も概ね適当なものとなっているが、理論的な裏付けがやや弱い。一方、ヨーロッパ諸国の一部で使われている手法である TRAMO-SEATS は、X-12-ARIMA に比べれば理論的なものであり、また Decomp のような状態空間モデルに基づいた更に理論的な手法も開発されており、こうした理論的な手法への移行が今後の方向ではないかと考える。したがって、将来を見据えれば、X-12-ARIMA 以外の手法についても何らかの形で明らかにしてはどうか。

→ 季節調整の手法の国際的な動向については今後とも注視していきたい。

また、季節調整法の適用に当たっての統計基準を設定した際には、各府省に対

して当該基準の運用に関する留意点などを文書で示すことを想定しており、その中で X-12-ARIMA 以外の手法についても何らかの言及をすることにより将来的な動向にも配慮する形にしてはどうかと考えている。

- 基準案の第2項の(1)の公表すべき季節調整の運用に関する情報のうちの「④オプション等の見直しの頻度及び時期」についてだが、公的統計分野の各種経済時系列データの場合、現在、どのくらいの頻度でどのような時期に行われているのか。
→ 1年に1回、12月までのデータが出そろった時点でオプション等を見直しているケースが多い。
- 民間エコノミストは、季節調整値の再現可能性が重要だと考えているようだが、この基準案により、季節調整法の運用に関する情報が適切に公表されることは再現可能性に寄与するものなのか。
→ 現在でも平成9年の統計審議会の指針に沿って、当該情報の公表が行われていることから再現は可能だと思うが、この基準案により更にきめ細かく公表されることになるため、再現可能性は向上するものと考えている。
- X-12-ARIMA 以外の手法について現在、研究されている府省はあるか。
→ 内閣府が X-12-ARIMA と TRAMO-SEATS との比較に関する研究論文をホームページに掲載している他、総務省でも TRAMO-SEATS の技術的側面に関する研究事例がある。なお、当該事例における TRAMO-SEATS と X-12-ARIMA との季節調整値の比較検証では、両者に顕著な差異は生じなかったという結果が出ている。

(2) 答申（案）について

事務局から、答申（案）について説明を行った後、審議が行われた。当該案について原案どおり了承され、平成23年2月24日開催予定の統計委員会において、部会長から報告することとなった。

(3) その他

委員等から、季節調整法等に関し、以下のとおりの質問・意見があった。

なお、これらの内容に関して、部会長から、各府省において今後の業務の参考にしてほしいとの発言があった。

- 今回の基準案では、「手法の継続的な使用」がひとつのポイントになっていると思うが、世界的な金融危機等が生じ、オプション等の例外的、臨時的な変更が想定されるときに、変更を推奨するのか、それとも定期的な見直し時以外はできるだけ変更しないことを勧めるのか、そのあたりの運用の方針はどのように想定しているか。
→ 経済時系列データが急激に変動したときに、データの急激な変動とそれが季節変動パターンにどの程度影響したかは区別して考えるべきだと思う。数年前の実例をみても、季節変動パターンは急激には変化しないと想定して、オプション等の見直しは定期的な見直し時に行われていたので、臨時的な変更を推奨することにはならないと考えている。

- 公的統計分野の統計データについて、データ源である統計調査の標本抽出率の制約から小地域の分析ができない場合、例えば都道府県別失業率のように、特定のモデルを設定して当該分析を試みることがあるが、こうしたモデルの設定・使用をどう考えるか全体的な検討をしておく必要がある。ユーザーが対応すべき範囲を考えるのか。特定のモデルを使って公的統計を作成してよいかどうか、使うとすればどこまでか、ということは今後検討することも重要と考える。

以 上

<文責 総務省政策統括官付統計審査官室>