

季節調整値算出時の異常値の取扱いに関する各府省の対応について（照会）

平成 21 年 12 月 9 日
財 務 省

1 照会の主旨

- ・ 100 年に 1 度の不況と言われており、昨年 9 月のリーマンショック以降、各種統計の数値にも大きな影響が生じていることと存じます。この異常な期間の数値を、季節調整値算出のための基礎データとしてどのように用いるべきなのか、疑問を抱いている次第です。
- ・ 世界金融危機の関連で、各種公的統計を用いた複合的な分析が重要視されていますが、季節調整値の算出方法の相違に起因して各種統計間の数値の捉え方にズレが生じてしまうのではないかと問合せが寄せられています。
- ・ 貿易統計に関して言えば、年間の季節的な変動が大よそ定まっていたのですが、ここ 1 年間の動向を見ると、ショックによる影響のほうははるかに大きく、季節調整値をブレさせているようにも感じます。
(貿易統計の季節調整値は、過去 10 年分の数値を基に X-12-ARIMA により算出していますが、この季節調整期間を毎月スライドさせ、直近の月の数値をも反映させた形で毎月季節調整替えを行っていることから、直近 1 年間の異常値、特に前年同月分の影響が直接的に出始めているものと思われます。)
- ・ 貿易統計の季節調整値の算出にあたっては、異常値への対応も含め、その算出方法の適正性について外部有識者に検証して頂いておりますが、この縦に深く掘り下げるような個別の検討に加えて、公的統計の一つとして、政府機関が作成・公表している他の統計での対応と比較し、横に広く検討することを期しています。
- ・ というのも、個別統計として最適な処理方法を見出したとしても、それが他の公的統計と比較して突出した特異なものになってしまう場合等、同じ政府の機関が作成しているにもかかわらず統計毎にバラバラな対応と指摘されかねないことから、個別の検討の結果に加え、公的統計としての整合性を出来る限り確保するという観点からも、対応方法を判断していきたいと考えております。
- ・ この対応方法については、前回経済指標専門会議において、「統計毎に様々な特性があり、十把一絡げに論ずることは難しく、個別の統計毎に検討を行うことが最適である」とされたところですが、この個別の検討を行う際、横に広く検討することが可能となるよう、参考情報として、各府省庁における他の公的統計での処理方法を承知したく存じます。

- なお、経済指標専門会議では、指数や季節調整の統一的基準を策定する等、同じ政府機関が作成する各種公的統計の整合性を図るための方策を議論しており、今回の提案は当該会議の趣旨に合致したものと考えております。また、貿易統計以外の多くの公的統計において、次の1年間の季節要素の予測値を算出する時期に差しかかり、本年分の異常な数値をどう取扱うか各省庁で検討を開始する頃と思われるところ、今タイミングで、情報共有して頂ければ非常に有益であると考えています。

2 照会事項

別紙のとおり表中の網掛け部分に関する各府省庁の対応（予定を含む）