

第12回経済指標専門会議 議事概要

- 1 日時 平成23年11月30日(水) 10:00~11:00
- 2 場所 経済産業省別館10階 1020会議室
- 3 出席者 【学識経験者】西郷委員、小巻委員、樋田委員
【関係府省等】内閣府、総務省(統計局)、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
【事務局】高田総務省統計審査官ほか

4 議題

- (1) 鉱工業指数平成22年基準改定方針(案)について
(2) その他
X12-ARIMAのデータ数上限について

5 議事概要

- (1) 鉱工業指数平成22年基準改定方針(案)について

経済産業省から、資料1に基づき、鉱工業指数平成22年基準改定方針(案)について、説明が行われた。「指数の基準に関する統計基準」に従って改定することがメインであるが、改定のポイントは、次の4点。

- ① 前回の基準改定以降、リーマンショックや東日本大震災などによる特異値があり、季節調整に用いる最適スペックを新基準のデータを用いて判断する必要があるため、基準の切替え時期を前回より2か月遅らせ、切替えは平成25年6月(平成25年4月分確報)を予定
- ② 総合系列の季節調整において、間接調整方法の導入の可能性を検討
- ③ 平成24年経済センサスの実施に伴い、基準年ウエイトの基礎データである平成22年工業統計が全数調査ではなく、「従業者規模1~3人」の事業所を調査対象としない形で行われ、必要な情報が完全には得られないため、一部補完推計を行って、ウエイトを作成
- ④ 日本標準産業分類第12回改定への対応
説明後の主な質疑応答は以下のとおり。

- 基幹統計としての情報公開を行うことが重要。どんな改定を行っても、何らかの指摘を受けるものだが、全てを公開するようにしてほしい。また、季節調整の間接調整法は、国際的な動向も踏まえて、検討過程や内容について基準改定公表時の解説書などでしっかりと説明するとよい。リーマンショックの影響は、アメリカの鉱工業指数では季節調整の改定のたびにマイナス幅が大きくなる傾向があるようだ。諸外国におけるリーマンショックの影響も参考にするとよいだろう。
- 一時期、世間の関心が季節調整の方法に集まったことがあったが、指数を作成するツールである季節調整のみが議論されることには違和感があった。先程、前回の基準改定以降、リーマンショックや東日本大震災という特異な事象があったとの説

明があったが、加えて、タイの洪水被害の影響などもあるかもしれないので、十分に検討してほしい。また、「従業者規模 1～3 人」のデータの推計は致し方ないが、「従業者規模 1～3 人」と「従業者規模 4～9 人」との動きの違いなども検証しておいた方がよい。

日本標準産業分類改定への対応作業に、支障はないか。

→ 基礎統計である工業統計が既に対応済みなので、鉱工業指数側は問題なく作業できる。

(2) その他

X12-ARIMA プログラムは、その仕様上、扱える時系列データ数の上限が 720 個（月次系列で 60 年分）という制限がある。このうち、通常 4 年分は ARIMA モデルの先行き予測に割り当てるため、実際に季節調整ができる期間は最長で 56 年分となる。

日本銀行が公表している季節調整値の中には、データの始期が 1955 年となっているものがあり、本年（2011 年）の季節調整替え（2010 年までのデータを使用）で、56 年分のデータ数上限を使い切った形となり、来年以降はこれまで通りの方法での季節調整替えが不可能な状態となっている。

このような状況を受け、X12-ARIMA のデータ数上限への対応（用いるデータの始期やデータ数、改定期間、公表の仕方など）について、日本銀行から意見照会があった。

主なやりとりは以下のとおり。

- アメリカの PPI の季節調整値は、毎年直近 60 か月分のみを再計算し、それ以前のデータは改定されていない。そのような諸外国の例も参考にしてはどうか。季節調整の計算に用いるデータの期間等は貴行の判断でよいと思うし、安定的な結果が得られるのであれば、断層は問題にしくなくてもよいのではないか。
- 試算結果等は根拠資料として公開すべきである。
- 用いるデータは長期であればよいというものではないので、この際、全面的に見直すのもよいだろう。見直し前後の断層などは、説明責任が果たせていれば問題ない。
- 各指標の季節調整に用いるデータ期間や選択しているオプション等は、総務省統計局・政策統括官（統計基準担当）・統計研修所ホームページに一覧表を掲載している。

以上