

## 季節調整における適切な対応に向けて

月次又は四半期ごとに公表する統計における季節調整に関し、新型コロナウイルス感染症の時期における季節調整の工夫について統計技術の観点から評価を行った。その結果に基づき、「季節調整法の適用に当たっての統計基準」を踏まえつつ、次に社会経済情勢が大きく変動する事案が発生した場合に備えて、以下のとおり考え方をとりまとめる。

なお、実際、社会経済情勢が大きく変動した場合、この考え方に即した季節調整における各府省の対応について、統計委員会評価分科会において整理し、取りまとめるものとする。

### 1 季節調整に関する基本的な考え方

#### (1) 季節調整法を適用する場合の手法

月次又は四半期ごとに公表する統計において、季節調整法を適用する場合は、特定の手法に限定するのではなく、当該統計における系列に適した手法を採用する。その際、統計の継続性を考慮しつつ、統計技術の進歩を積極的に取り込むよう努める。

#### (2) 社会経済情勢の変動期における対応

社会経済情勢が大きく変動する事案が発生した場合、所管する月次又は四半期ごとに公表する統計の季節調整値の改定時に、適切な季節調整の外れ値を設定する。その際、過去に同種の事案が発生した場合における知見を参照するとともに、必要に応じ、外部有識者の意見を聴いた上で迅速に対応するよう努める。

### 2 季節調整に関する方法の透明性及び再現性の確保

統計の透明性及び再現性を確保し、利用者の利便性を向上させる観点から、以下の対応を行う。なお、現時点における各府省の対応は、別添のとおりである。

#### (1) 季節調整に関する情報の公表

季節調整値に加え、実際に設定した外れ値及びその期間について、インターネットの利用その他の適切な方法により公表する。

#### (2) 季節調整に関する文書などの共有及び保存

2 (1)に掲げる内容の文書など季節調整に関する内容を含む文書については、組織で確実に共有がなされるよう、適切に保存する。

### 3 季節調整に関する PDCA サイクルの確立及び情報の共有

季節調整を行った場合、実際の季節調整値の動きなどに関する事後検証を行うよう努める。こうした事後検証の結果については、将来、1 (2) における対応において参照する可能性も考慮して、資料の公表、論文の発表等を通じて、可能な限り、他府省や統計の利用者と知見を共有するよう努める。

季節調整系列におけるARIMAモデル、外れ値等に関する情報の記録・保管及び引継ぎの状況

| 府省等名     | 統計名        | X-12-ARIMAの事前調整機能を利用している季節調整系列 |                   | ARIMAモデル・外れ値  |                    | 外れ値の設定方法    | 外れ値の設定理由      |    |
|----------|------------|--------------------------------|-------------------|---------------|--------------------|-------------|---------------|----|
|          |            | 月次、四半期の別                       | 系列数               | 記録・保管及び引継ぎの状況 | 公表                 |             | 記録・保管及び引継ぎの状況 | 公表 |
| 内閣府      | 四半期別GDP速報  | 四半期                            | 74                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査※ | ○             | ○  |
| 内閣府      | 景気ウォッチャー調査 | 月次                             | 60                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 総務省      | 労働力調査      | 月次                             | 24                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 総務省      | 家計調査       | 月次                             | 10                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 総務省      | 消費動向指数     | 月次及び四半期                        | 月次 62<br>四半期 62   | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 総務省      | 消費者物価指数    | 月次                             | 13                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 財務省      | 法人企業統計調査   | 四半期                            | 10                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 財務省      | 国際収支統計     | 月次                             | 20                | ○             | ○<br>(設定期間は今後公表予定) | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 厚生労働省    | 職業安定業務統計   | 月次                             | 302               | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 厚生労働省    | 雇用保険業務統計   | 月次                             | 8                 | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 厚生労働省    | 毎月勤労統計調査   | 月次                             | 33                | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 日本銀行     | 銀行券発行高     | 月次                             | 2                 | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 日本銀行     | マネーストック    | 月次                             | 9                 | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             |    |
| 日本銀行     | マネタリーベース   | 月次                             | 2                 | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 日本銀行     | 資金循環統計     | 四半期                            | 4                 | ○             | ○                  | 社会経済情勢等の精査  | ○             | ○  |
| 内閣府      | 機械受注統計     | 月次                             | 9                 | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 内閣府      | 消費動向調査     | 月次                             | 4                 | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 内閣府      | 景気動向指数     | 月次及び四半期                        | 月次 2<br>四半期 1     | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 内閣府及び財務省 | 法人企業景気予測調査 | 四半期                            | 6                 | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 財務省      | 貿易統計       | 月次                             | 2                 | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 経済産業省    | 鉱工業指数      | 月次                             | 177               | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 経済産業省    | 第3 次産業活動指数 | 月次                             | 大分類 11<br>全系列 281 | ○             | ○<br>( 近日公表予定)     | プログラムの自動検出  |               |    |
| 経済産業省    | 商業動態統計調査   | 月次                             | 45                | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 国土交通省    | 建築着工統計調査   | 月次                             | 19                | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |
| 国土交通省    | 建設工事受注動態統計 | 月次                             | 9                 | ○             | ○                  | プログラムの自動検出  |               |    |

※ 速報期間については、プログラムの自動検出