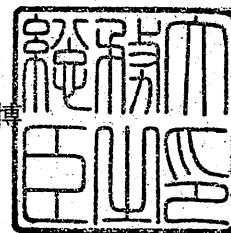


総政企第6号
平成23年1月26日

統計委員会委員長
樋口美雄 殿

総務大臣
片山善博



諮問第35号

「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（諮問）

標記について、別紙のとおり設定するに当たり、統計法（平成19年法律第53号）第28条第2項の規定に基づき、統計委員会の意見を求める。

諮 問 の 概 要

(「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)

1 季節調整法の適用に当たっての統計基準の目的等

経済時系列データにより短期的な経済動向を分析するに当たっては、当該時系列データの原数値には自然的要因(気温、天候等) 制度的要因(企業の決算期等)及び社会的要因(年始年末、盆等)による1年を周期として繰り返される定期的な変動である「季節変動」が含まれていることがあることから、原数値を用いた分析は必ずしも適当でない。このため、当該分析の際には、経済時系列データの原数値から季節変動による影響を除去する「季節調整」が行われている。なお、当該影響を除去した数値を「季節調整値」という。

この季節調整の手法(以下「季節調整法」という。)としては、米国センサス局が開発したX-12-ARIMA等様々なものがあるが、経済時系列データに対して継続的に同一の手法が適用されずに頻繁に手法が変更された場合や、適切性が評価されていない季節調整法が適用された場合、当該時系列データの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)について、その情報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利用者が、当該時系列データにおける季節調整値間の比較の適否を十分に判断することができなくなる。さらに、短期的な経済動向の分析に当たって必須となる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も困難となる。

こうしたことから、経済時系列データにおける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。

2 季節調整法の適用に当たっての統計基準を設定する理由

季節調整法の適用については、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)」(以下「統計審議会指針」という。)において、適用する場合の手法は適切性について一般的な評価を受けているものを継続的に使用すること、選定したオプション等の季節調整法の運用に関する情報を報告書等に掲載すること等が示され、当該適用に関する実務上の基準として、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いる。

また、この統計審議会指針における及びの内容は、現在でも、時系列データにおける季節調整値間の比較及び季節調整値の客観性の確保や複数の時系列データの総合的な利用の観点から依然として重要なものである。

一方、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、公的統計の作成に当たり、従来 of 統計分類のみならず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った。

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し、平成 22 年度中に公示することとされている。

3 今回定めようとする季節調整法の適用に当たっての統計基準の内容

今回諮問する「季節調整法の適用に当たっての統計基準」は、平成 9 年の統計審議会指針を基礎としつつ、その各府省におけるこれまでの運用実績等を踏まえ、以下のとおり、利用者の利便の向上や情報通信環境の変化への対応のために必要な修正を行った別紙のものとする。

季節調整値の利用者の利便の向上

季節調整法の運用に関する情報として公表する事項について、季節調整値の利用者の利便の向上の観点から、オプション等の設定内容など具体的かつ詳細なものに変更する。

さらに、オプション等の設定内容の重大な変更や適用している手法の変更を行う場合には、季節調整値の利用に当たり影響が大きいことに鑑み、変更の影響(例えば手法の変更の場合、旧手法による季節調整値と新手法による季節調整値の差異等)も公表することを追加する。

情報通信環境の変化への対応

季節調整法の運用に関する情報の公表方法の選択肢として、季節調整値の作成機関、利用者双方の情報通信環境の変化を踏まえ、報告書等への掲載の他にインターネットの利用等の方法を追加する。

季節調整法の適用に当たっての統計基準（案）

1 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（X-12-ARIMA等）。

2 季節調整法の適用に関する公表事項

(1) 季節調整法の適用に当たっては、次に掲げる季節調整法の運用に関する情報を、季節調整値と併せ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ものとする。

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

オプション等の見直しの頻度及び時期

季節調整値の改定の頻度及び時期並びに改定の対象とするデータ期間

その他参考となるべき事項

(2) 前記(1)の場合において、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、変更の影響（例えば変更前に公表された季節調整値と変更後の季節調整値の差異）を併せて公表するものとする。

3 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（例えば旧手法による季節調整値と新手法による季節調整値の差異）を、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ものとする。

「季節調整法の適用に当たっての統計基準」案の概要

「季節調整の適用に当たっての統計基準」とは

経済時系列データによる短期的な経済動向の分析のため、当該データの原数値から、自然的要因や制度的・社会的要因による1年を周期として繰り返される定期的な変動である「季節変動」の影響を除去することを「季節調整」、除去した数値を「季節調整値」、季節調整の手法を「季節調整法」という。

「季節調整法の適用に当たっての統計基準」とは、季節調整の手法や季節調整法の運用に関する情報の公表事項等に係る基準を定めたものである。

「季節調整の適用に当たっての統計基準」案の概要

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)」を基に、各府省におけるこれまでの運用実績、現在の社会経済状況等を勘案



「季節調整法の適用に当たっての統計基準」(今回諮問案)

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【表現振りの変更】

季節調整法の適用に当たっては、同法の運用に関する情報(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・設定理由、 オプション等の見直しの頻度・時期、 季節調整値の改定の頻度・時期、改定の対象とするデータ期間、 その他参考となるべき事項)を、季節調整値と併せて公表【公表事項の詳細化】

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 からの事項と併せて、変更の影響(例えば変更前に公表された季節調整値と変更後の季節調整値の差異)も公表【公表事項の追加】

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、変更の影響(例えば旧手法による季節調整値と新手法による季節調整値の差異)を公表【公表事項の追加】

季節調整法の運用に関する情報の公表については、インターネットの利用等の方法により実施【公表方法の選択肢の追加】

「季節調整法の適用に当たっての基準」に係る対照表

別添 2

「季節調整法の適用に当たっての統計基準」(案)	「季節調整法の適用について(指針)」(平成9年統計審議会了承)	変更理由
<p>1 <u>季節調整法を適用する場合の手法</u> 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(X-12-ARIMA等)。</p> <p>2 <u>季節調整法の適用に関する公表事項</u> (1) <u>季節調整法の適用に当たっては、次に掲げる季節調整法の運用に関する情報を、季節調整値と併せ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ものとする。</u> <u>手法の名称</u> <u>推計に使用するデータ期間</u> <u>オプション等の設定内容及び設定理由</u> <u>オプション等の見直しの頻度及び時期</u> <u>季節調整値の改定の頻度及び時期並びに改定の対象とするデータ期間</u> <u>その他参考となるべき事項</u> (2) <u>前記(1)の場合において、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、変更の影響(例えば変更前に公表された季節調整値と変更後の季節調整値の差異)を併せて公表するものとする。</u></p> <p>3 <u>手法を変更した場合の公表事項</u> <u>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(例えば旧手法による季節調整値と新手法による季節調整値の差異)を、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ものとする。</u></p>	<p>1 <u>季節調整法を適用する場合は、センサス局法X-12-ARIMAなど、手法の適切性について一般的な評価を受けている手法を継続的に使用する。統計作成機関は、適用する手法を選定した理由を明らかにする。</u></p> <p>2 <u>季節調整法を適用する際の推計に使用するデータ期間、オプション等の選定に当たっては、それぞれの系列に対して統計作成機関において適切と考えられ、客観性が保たれる基準を採用し、継続的に使用する。</u></p> <p>3 <u>データの追加又は期間の追加に伴って、オプション等の変更又は過去の季節調整値の変更を実施する頻度については、あらかじめ統計作成機関において基準を定め、利用者の利便性を考慮し、継続的にその基準を使用する。</u></p> <p>4 <u>適用している季節調整法については、その名称、推計に使用しているデータの期間、オプション等の選択基準、選定したオプション等の季節調整に関する情報を報告書等に掲載する。</u> <u>また、適用している季節調整法、オプション等の選択の基準等の変更を行う場合は、変更の趣旨及び変更後の手法、基準等についても、報告書等に掲載する。</u></p> <p>5 <u>統計作成機関は、季節調整法に関する情報について、別途定める様式に従い、統計基準部に提出することとする。</u> <u>統計基準部は、統計作成機関から提出された各々の情報について、一覧性のある資料に取りまとめて、一般に開示する。</u></p>	<p>わかりやすさの観点から各項の内容を要約した見出しを追加(基準案第1項、第2項、第3項)。 国際比較可能性の向上の観点から、表現振りを変更(基準案第1項)。</p> <p>近年、公的統計である各経済時系列データの季節調整に用いられている手法はX-12-ARIMA(X-11を含む)に収斂していることから、手法の選定理由を示す必要性が低下したため、当該理由に関する規定を削除(基準案第1項)。 指針第2項及び第3項で掲げられている季節調整法の運用に関する事項を基準案の第2項にまとめた上で、指針第4項の当該事項に関する公表規定を取り込み、公表事項をより詳細に規定。一方、指針第2項及び第3項の当該事項に関する基準の設定等については、上記規定により季節調整法の運用に係る透明性が確保されるため削除(基準案第2項(1))。 季節調整法の運用に関する情報の公表方法については、季節調整値の作成機関、利用者双方の情報通信環境の進展を踏まえ、公表方法の選択肢として、インターネットの利用による方法を追加(基準案第2項及び第3項)。 オプション等の設定内容の重大な変更や適用している手法の変更は、季節調整値の利用に当たり影響が大きいことに鑑み、変更の影響を公表する規定を追加(基準案第2項(2)及び第3項)。 指針第5項の統計基準部による季節調整に関する情報の一括提供については、インターネットの普及により、季節調整値の作成機関が全てホームページを有していることから、当該提供を各機関のホームページ上で提供することとして削除。</p>