

季節調整モデルの変更について

法人企業統計四半期別調査の季節調整値については、米国商務省センサス局が開発した X-12-ARIMA を利用しています。

季節調整モデルについては、学識経験者を中心とした法人企業統計研究会において毎年定期的に見直しを行っており、妥当性を検討しておりますが、より適切な季節調整を行うため、令和 7 年 4－6 月期調査（9 月 1 日公表予定）において、以下の設定変更を行う予定です。

記

1. 季節調整に用いるデータ期間

法人企業統計四半期別調査における季節調整では、使用するデータの始期をこれまでは 1985 年 4－6 月期に固定していましたが、法人企業統計研究会で議論を行った結果、データ期間を直近の一定期間に固定する方が季節調整の安定性の観点から適切であり、推定精度の担保のために十分なデータ数を確保する観点から、データの利用期間は 120 期間が適当である、との結論を得ました。

このため、今後は当期を含む直近 120 期間（30 年）に固定することといたします。なお、結論に至った過程については、研究会の議事要旨をご参照ください。

（参考）法人企業統計研究会

<https://www.mof.go.jp/pri/reference/ssc/summary/kenkyukai.htm>

2. 採用する ARIMA モデルの変更

系列項目		新	旧
売上高	製造業	(212) (012)	(212) (012)
	非製造業	(111) (011)	(012) (012)
営業利益	製造業	(212) (012)	(212) (112)
	非製造業	(212) (011)	(211) (012)
経常利益	製造業	(111) (112)	(111) (112)
	非製造業	(212) (110)	(011) (212)
設備投資 (ソフトウェアを除く)	製造業	(212) (012)	(212) (011)
	非製造業	(110) (112)	(110) (112)
設備投資 (ソフトウェア)	製造業	(112) (011)	(011) (110)
	非製造業	(011) (011)	(011) (011)

（注）赤字が変更箇所となります。

※ 詳細な分析結果については、琉球大学国際地域創造学部高岡慎准教授
「2025 年 4-6 月期以降に用いる X-12-ARIMA スペックについて」(2025 年
6 月)をご参照願います。

https://www.mof.go.jp/pri/reference/ssc/bunseki/report_20250623.pdf

※ なお、今回の見直しは「季節調整法の適用に当たっての統計基準」(平成
23 年 3 月 25 日総務省告示第 96 号)に沿った手続きとなっております。

以上

問合せ先

財務省 財務総合政策研究所 調査統計部

電話(代表) 03-3581-4111 (内線) 5499、5496