

令和7年6月23日(月)
13:00～14:30
対面及びオンライン開催

季節調整値について

◎ 前回(令和7年3月27日開催)の研究会で報告された法人企業統計調査の季節調整に用いるデータの利用期間の見直しに関する検討結果を踏まえ、季節調整におけるデータの利用期間及び2025年4～6月期以降の季節調整において採用すべきスペックについて、高岡先生より検討結果の報告(資料1)を行っていただいた。

◎ 委員からの主な意見

- ・ 製造業と非製造業で最適な期間が変わる可能性が考えられるが、考慮する必要はないか。
→ 季節調整の作成については、公表前の非常にタイトな期間で作業しているため、誤掲載のリスクを考慮し、可能であれば製造業と非製造業で同じデータ利用期間としたい。(事務局)
- ・ どこまで季節調整値を分割するかということは難しい問題であるが、事務局回答のとおり、公的統計としては分割せずシンプルに、一定のルールでやっているということをはっきりと表明した方がよい。
- ・ 月次の場合、年数を10年程度としている統計もあるが、数理モデル上は月次の10年と四半期の30年は、データ期間でみると同じであり、四半期では30年程度ないと結果が安定しないとする説明は納得しやすいと考える。
- ・ 公表値の改定が少なく済むようなやり方をもとに、どのデータ期間を設定するか検討する考え方は非常に実践的であり、高岡先生ご提案の120期間が適当だという考えに賛成。
- ・ 今回の季節調整に関する見直しについては、これまで研究会で色々と議論を行い、データ期間を固定した方が手法としては望ましく、回帰部分を考慮したうえで十分なサンプルサイズ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が得られたというアナウンスも行ってもらいたい。なお、これは総務省が定める「季節調整法の適用について(指針)」に沿った手続きであることを明確にしてほしい。

◎ 事務局まとめ

- ・ 季節調整に用いるデータ期間については、これまで研究会で議論を行っていただいた結果、データ期間を直近の一定期間に固定することは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、との結論が得られた。

このため、今後、法人企業統計調査の季節調整に用いるデータの利用期間は120期間とする。9月に公表する2025年4～6月期調査については、1995年4～6月期調査から足下までとして、それ以後1期ずつずらしていくような形で季節調整を実施する。

- ・ 2025年の季節調整値モデルのスペックについては、高岡先生の論文の表4-1に記載されている120期間の最適モデルを使用する。

(以上)