

GDP支出系列における1980年までの簡易遡及について

平成26年1月20日

内閣府経済社会総合研究所国民経済計算部

現行基準（平成17年基準）の国民経済計算体系については、GDP支出系列を含め、1994年以降の計数を正式系列として公表している。このたび、ユーザーの利便性の観点から、GDP支出系列について、簡易な遡及方法により1980年までの参考系列を作成した。

○簡易遡及の考え方

1980年～1993年のGDP旧基準（平成12年基準）支出系列について、以下の現行基準に合わせた概念調整を行った上でリンク係数を設定し、94年以降の正式系列と接続可能な系列を作成。

○概念調整

1. 民間・公的企業の分類変更

- ・ 集計値への影響の大きさに鑑み、旧3公社のうち旧基準と現行基準において公民の分類変更が行われた企業については、財務諸表の情報等から遡及して推計¹。それ以外の分類変更企業については、リンク係数を設定して接続。

2. 間接的に計測される金融仲介サービス（FISIM）の導入、自社開発ソフトウェアの固定資本形成への計上

- ・ 現行基準の推計方法により、1980年まで遡及して推計。

3. 国有林（育成資産）の見直し

- ・ 現行基準に合わせ、非生産資産として旧基準の仕掛品在庫から控除。

なお、上記以外の旧基準と現行基準の概念の差異については、個別の概念調整は行わず、季節調整を行う需要項目レベルごとにリンク係数を設定して現行基準に接続した。このため、本系列はあくまでも簡易的な遡及方法による参考系列である点に留意願いたい。

○接続の方法

名目原系列については、上記の概念調整を行った上で、需要項目ごとに1994年（暦年または年度）の現行基準と旧基準の計数の比率をリンク係数にして接続。暦年接続か年度接続かの判断は、原則として名目原系列推計に用いた年次基礎統計のベースに合わせる。

デフレーターについては、特段の概念調整は行わずに1994暦年または年度の現行基準と旧基準の計数の比率をリンク係数にして接続。

実質原系列については、リンク接続後の名目原系列をリンク接続後のデフレーターで除して算出。

ただし、民間在庫品増加は名目原系列、実質原系列それぞれにリンク係数を設定して接続し、公的在庫品増加は名目原系列、実質原系列ともに財務諸表等から推計。

なお、GDP等の集計実質値は、リンク接続後の各需要項目を連鎖統合して算出。

○季節調整値の算出

リンク接続後の名目原系列、実質原系列の計数をそれぞれ季節調整して算出。季節調整モデルの詳細な設定については別紙参照。

（以上）

¹ 日本たばこ産業株式会社、日本電信電話株式会社、東日本電信電話株式会社、西日本電信電話株式会社、北海道旅客鉄道株式会社、四国旅客鉄道株式会社、九州旅客鉄道株式会社、日本貨物鉄道株式会社の8社については、現行基準に合わせ民営化後も公的企業に分類。

(別添)季節調整用ARIMAモデル設定一覧

(1) 季節調整モデルの選択については、「推計手法解説書(四半期別GDP速報(QE)編)平成17年基準版」(平成24年11月8日)を参照されたい。

(2) 民間在庫品増加及び公的在庫品増加については、「国民経済計算調査会議基準改定課題検討委員会」等における議論の結果を踏まえ、季節性、非季節性共に階差をとらないモデル〔(0 0 0)(0 0 0)~(2 0 2)(2 0 2)〕81通りの中から選定している。

(3) 以下の季節調整モデルについて、①は昭和55年1-3月期~平成23年7-9月期、②は昭和55年1-3月期~平成5年10-12月期に適用するもの。

系列	ARIMAモデル (上段:名目、下段:実質)	閏年調整 (lpyear)	異常値・レベルシフト	
			種類、期	設定理由
国内家計最終消費支出	-	-	-	-
耐久財②	(2 1 0)(1 1 0) (2 1 0)(1 1 0)	×	VAT89(注)	平成元年4月の消費税導入に伴う駆け込み需要期(1-3月期)、及びその反動期(4-6月期)。その際、駆け込み需要と反動期は定量的に同量だけ逆に効くように設定。
半耐久財②	(2 1 2)(1 1 0) (1 1 1)(1 1 0)	×	VAT89(注)	平成元年4月の消費税導入に伴う駆け込み需要期(1-3月期)、及びその反動期(4-6月期)。その際、駆け込み需要と反動期は定量的に同量だけ逆に効くように設定。
非耐久財②	(0 1 2)(0 1 0) (0 1 1)(0 1 1)	×	VAT89(注)	平成元年4月の消費税導入に伴う駆け込み需要期(1-3月期)、及びその反動期(4-6月期)。その際、駆け込み需要と反動期は定量的に同量だけ逆に効くように設定。
サービス(除く持ち家の帰属家賃、FISIM)②	(2 1 2)(2 1 0) (2 1 2)(0 1 2)	×	VAT89(注)	平成元年4月の消費税導入に伴う駆け込み需要期(1-3月期)、及びその反動期(4-6月期)。その際、駆け込み需要と反動期は定量的に同量だけ逆に効くように設定。
サービス(持ち家の帰属家賃)①	(1 1 1)(0 1 1) (1 1 1)(0 1 1)	×	(なし)	
居住者家計の海外での直接購入①	(0 1 0)(0 1 1) (2 1 2)(0 1 1)	×	AO1991.1	湾岸戦争の影響で、平成3年1-3月期に出国日本人数が減少したため、加法型異常値を設定。
			AO2001.4	米国同時多発テロ事件(9.11)の影響で、平成13年10-12月期に出国日本人数が減少したため、加法型異常値を設定。
			AO2003.2	イラク戦争の影響で、平成15年4-6月期に出国日本人数が減少したため、加法型異常値を設定。
			LS2006.1	平成18年1-3月期より「国際収支統計」における旅行収支の計上方法が変更されたため、レベルシフト調整変数を設定。
非居住者家計の国内での直接購入①	(0 1 0)(0 1 1) (0 1 0)(0 1 1)	×	LS1986.4	昭和60年10月のブラザ合意を受けた急激な円高により訪日外客数が減少したため、レベルシフト調整変数を設定。
			LS2003.1	平成15年1-3月期より「国際収支統計」における旅行収支の計上方法が変更されたため、レベルシフト調整変数を設定。
			AO2003.2	イラク戦争の影響で、平成15年4-6月期に訪日外客数が減少したため、加法型異常値を設定。
			LS2006.1	平成18年1-3月期より「国際収支統計」における旅行収支の計上方法が変更されたため、レベルシフト調整変数を設定。
政府個別消費支出①	(0 1 1)(1 1 0) (0 1 2)(0 1 1)	×	LS1997.3	医療制度変更(平成9年9月)に伴い、レベルシフト調整変数を設定。
			LS2000.2	平成12年度から公的介護保険制度が導入されたことに伴い、12年4-6月期以降、介護保険給付が計上されていることから、12年4-6月期以降について、レベルシフト調整変数を設定。
			LS2002.4	医療制度変更(平成14年10月)に伴い、レベルシフト調整変数を設定。
政府集合消費支出(除くFISIM)①	(1 1 2)(0 1 1) (1 1 1)(0 1 1)	×	(なし)	
民間住宅①	(0 1 1)(0 1 1) (0 1 1)(0 1 1)	×	(なし)	
民間企業設備②	(2 1 2)(1 1 0) (1 1 2)(1 1 0)	×	LS1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、レベルシフト調整変数を設定。
			LS1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、レベルシフト調整変数を設定。
公的住宅①	(0 1 0)(1 1 2) (0 1 0)(1 1 1)	×	(なし)	
公的企業設備①	(2 1 2)(2 1 1) (2 1 2)(2 1 2)	×	LS1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、レベルシフト調整変数を設定。
			LS1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、レベルシフト調整変数を設定。
一般政府総固定資本形成①	(2 1 2)(0 1 1) (2 1 1)(1 1 0)	×	(なし)	
民間原材料在庫品増加②	(2 0 2)(2 0 1) (0 0 0)(2 0 1)	×	AO1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			AO1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
民間仕掛品在庫品増加②	(0 0 2)(1 0 0) (0 0 2)(1 0 0)	×	AO1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			AO1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
民間製品在庫品増加②	(2 0 2)(2 0 0) (2 0 2)(2 0 0)	×	AO1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			AO1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			VAT89(注)	平成元年4月の消費税導入に伴う駆け込み需要期(1-3月期;在庫減要因)、及びその反動期(4-6月期;在庫増要因)。その際、駆け込み需要と反動期は定量的に同量だけ逆に効くように設定。
民間流通在庫品増加②	(2 0 2)(1 0 1) (2 0 0)(1 0 1)	×	AO1985.2	日本専売公社・日本電信電話公社の民営化(昭和60年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			AO1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、加法型異常値を設定。

公的企業在庫品増加①	(102)(102) (102)(102)	×	AO1985.2	日本専売公社・日本電信電話会社の民営化(昭和60年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
			AO1987.2	日本国有鉄道の民営化(昭和62年4月)の影響で、加法型異常値を設定。
一般政府在庫品増加①	(201)(101) (201)(100)	×	(なし)	
財貨の輸出①	(010)(011) (110)(011)	×	LS2008.4	世界同時不況の影響による、平成20年秋以降の変動に対して、レベルシフト調整変数及び一時的変化(TC)を設定
			TC2009.1	
			AO2011.2	東日本大震災の影響による、平成23年春以降の変動に対して、加法型異常値を設定
サービスの輸出(除く非居住者家計の国内での直接購入、FISIM)①	(010)(011) (010)(011)	×	(なし)	
財貨の輸入①	(011)(011) (212)(012)	×	名目	世界同時不況の影響による、平成20年秋以降の変動に対して、レベルシフト調整変数を設定
			LS2008.4	
			実質	LS2009.1
サービスの輸入(除く居住者家計の海外での直接購入、FISIM)①	(010)(011) (010)(011)	×	(なし)	
海外からの所得の受取①	(212)(011) (212)(011)	×	LS1996.1	当該項目の推計の基礎統計である「国際収支統計」において、平成7年以前については、本来なら本項目から控除されるべきである「金融派生商品」分が把握できないため、平成7年と8年の間で段差が生じている。よって、これを処理するため、当該変数を設定。
海外に対する所得の支払①	(111)(011) (111)(011)	×	LS1996.1	同上

(注)1. VAT89は当方で定義した変数であり、1989.1=1、1989.2=-1とし、他の期は0と設定。

2. 在庫系列については加法型、在庫以外の系列については乗法型で季節調整を行う。

(参考)スペックファイルの例(名目国内家計最終消費支出(うち半耐久財))

```
series { start =1980.1
span =(1980.1,1993.4)
modelspan =(1994.1,1993.4)
period=4
decimals =3
precision =3}
transform { function=log }
arma { model = ( 2 1 2 )( 1 1 0 ) }
forecast { maxlead = 8
maxback = 20 }
regression {
user = ( vat89 )
file = "xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx"
}
estimate { maxiter = 20000 }
x11{ savelog = q
appendfcst = yes
save = ( d11 d16 ) }
```