

平成 19 年 7 月 31 日
経済社会総合研究所
国民経済計算部

1 次 QE の推計精度の向上に関する推計方法の変更について

平成 19 年 7 月 5 日に開催された国民経済計算調査会議第 3 回推計手法検討委員会 (<http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/giji.html>) において、四半期別 GDP 速報 (QE) の 1 次 QE から 2 次 QE への改定幅を縮小するための改善策について議論を行ったところ、以下の 2 点に関する推計方法の変更が了承されたため、8 月 13 日 (月) 公表の 19 年 4-6 月期 1 次 QE より同推計方法を採用することとする。

1. 民間在庫品増加

<変更後>

原材料在庫及び仕掛品在庫について、1 次 QE 段階では、季節調整の際に利用している ARIMA モデルにより名目及び実質原系列を推計する。季節調整済系列 (名目・実質) は、こうして得られた原系列に対し、通常どおりセンサス局法 X-12-ARIMA を用いて季節調整を施すことによって求める (注)。

<変更前>

原材料在庫及び仕掛品在庫について、1 次 QE 段階では、名目及び実質季節調整済 GDP 前期比寄与度をゼロと仮置き。すなわち、原材料在庫品増加及び仕掛品在庫品増加の名目及び実質季節調整済値は、前期 2 次 QE と同値と仮定。原系列 (名目・実質) は、こうして得られた季節調整済値を予定季節指数で転換することにより求める。

なお、2 次 QE 段階では『四半期別法人企業統計調査』を利用して推計することについては変更がない。

2. 供給側出荷額推計

供給側 QE 出荷額 (90 品目分類) の推計において、『生産動態統計』を基礎統計とする品目については、1 次 QE 段階では『生産動態統計』の 3 ヶ月

目の値を以下の①、②いずれかの方法によって補外しているが、19年4-6月期1次QE以降、一部の品目を①から②に変更する。（別紙1.2参照）

<対象品目>陶磁器、特殊産業機械、その他の一般機械機器、重電機器

<補外方法>①『生産動態統計』の最初の2ヶ月分の前年比を用いて補外。

② 鉱工業出荷指数^{*}(IIP)×企業物価指数(CGPI)（ともに3ヶ月目は速報値）の前月比を『生産動態統計』の2ヶ月目に乗じて補外。

*ただし、『生産動態統計』の「生産金額」をもとに出荷額推計を行う品目の補外には鉱工業生産指数を採用。

(注) 19年4-6月期における民間在庫品増加（原材料在庫及び仕掛品在庫）の実質季節調整済前期差について

19年1-3月期2次QEで利用した情報を用い、ARIMAモデルにより4-6月期の民間在庫品増加（原材料在庫及び仕掛品在庫）の実質値を算出すると、その季節調整済前期差は合計▲337.8（十億円）となる（変更前はゼロと仮置き）。ただし、19年4-6月期1次QEでは、その後追加的に得られた情報も利用して推計が行われる点に留意願いたい。

なお、上記の民間在庫品増加（原材料在庫及び仕掛品在庫）の実質季節調整済前期差に関する次期1次QEにおける仮置き値については、今後、各期2次QEの「その他の留意事項」において公表することとする。

【見直し後】

IIP×CGPI で補外する品目	生産動態統計で補外する品目
①24. パルプ・紙 ②25. 紙加工品 ③27. 基礎化学製品 ④30. 化学最終製品 ⑤33. プラスチック製品 ⑥34. ゴム製品 ⑦36. ガラス・ガラス製品 ⑧37. セメント・セメント製品 ⑨38. 陶磁器 ⑩39. その他の窯業・土石製品 ⑪44. 建設用・建築用金属製品 ⑫45. その他の金属製品 ⑬47. 特殊産業機械 ⑭48. その他の一般機械機器 ⑮49. 事務用・サービス用機器 ⑯50. 民生用電気機械 ⑰52. 重電機器 ⑱53. その他の電気機器 ⑲58. その他の製造工業製品	①22. 製材・木製品* ②23. 家具・装備品* ③35. なめし革・毛皮・同製品 ④46. 一般産業機械 ⑤56. その他の輸送用機械・同修理 ⑥57. 精密機械 (1) 5107. 無線電気通信機器 (2) 5109. 電子応用装置 (3) 5111. 半導体素子
(1) 5101. パーソナルコンピュータ (2) 5102. 電子計算機本体・同付属装置 (3) 5103. 外部記憶装置及び表示装置 (4) 5104. 入出力装置及びその他の付属装置 (5) 5105. 有線電気通信機器 (6) 5106. 携帯電話機 (7) 5110. 電子計測器 (8) 5112. 集積回路 (9) 5114. 液晶素子 (10) 5401. 乗用車 (11) 5402. トラック・バス・その他の自動車 (12) 5403. 二輪自動車	

* 「22. 製材・木製品」及び「23. 家具・装備品」については、該当する IIP の速報値が公表されない品目が多いため、現行通り、生産動態統計により補外を行う。

* 「5108. その他の電気通信機器」、「5113. 電子管」、「5115. 磁気テープ・磁気ディスク」及び「5116. その他の電子部品」については、生産動態統計に対応する品目がないため、「51. 電子・通信機器」の合計の伸びにより補外を行う。

* 「5404. 自動車車体」、「5405. 自動車内燃機関・同部分品」、「5406. 自動車部品」については、生産動態統計に対応する品目が1品目もしくは全くないため、「54. 自動車」の合計の伸びにより補外を行う。

* 下線は平成19年4-6月期より補外方法を変更する品目。

【見直し前】

IIP×CGPI で補外する品目	生産動態統計で補外する品目
① 24. パルプ・紙	① 22. 製材・木製品*
② 25. 紙加工品	② 23. 家具・装備品*
③ 27. 基礎化学製品	③ 35. なめし革・毛皮・同製品
④ 30. 化学最終製品	④ 38. 陶磁器
⑤ 33. プラスチック製品	⑤ 46. 一般産業機械
⑥ 34. ゴム製品	⑥ 47. 特殊産業機械
⑦ 36. ガラス・ガラス製品	⑦ 48. その他の一般機械機器
⑧ 37. セメント・セメント製品	⑧ 52. 重電機器
⑨ 39. その他の窯業・土石製品	⑨ 56. その他の輸送用機械・同修理
⑩ 44. 建設用・建築用金属製品	⑩ 57. 精密機械
⑪ 45. その他の金属製品	
⑫ 49. 事務用・サービス用機器	(1) 5107. 無線電気通信機器
⑬ 50. 民生用電気機械	(2) 5109. 電子応用装置
⑭ 53. その他の電気機器	(3) 5111. 半導体素子
⑮ 58. その他の製造工業製品	
(1) 5101. パーソナルコンピュータ	
(2) 5102. 電子計算機本体・同付属装置	
(3) 5103. 外部記憶装置及び表示装置	
(4) 5104. 入出力装置及びその他の付属装置	
(5) 5105. 有線電気通信機器	
(6) 5106. 携帯電話機	
(7) 5110. 電子計測器	
(8) 5112. 集積回路	
(9) 5114. 液晶素子	
(10) 5401. 乗用車	
(11) 5402. トラック・バス・その他の自動車	
(12) 5403. 二輪自動車	

* 「22. 製材・木製品」及び「23. 家具・装備品」については、該当する IIP の速報値が公表されない品目が多いため、現行通り、生産動態統計により補外を行う。

* 「5108. その他の電気通信機器」、「5113. 電子管」、「5115. 磁気テープ・磁気ディスク」及び「5116. その他の電子部品」については、生産動態統計に対応する品目がないため、「51. 電子・通信機器」の合計の伸びにより補外を行う。

* 「5404. 自動車車体」、「5405. 自動車内燃機関・同部分品」、「5406. 自動車部品」については、生産動態統計に対応する品目が1品目もしくは全くないため、「54. 自動車」の合計の伸びにより補外を行う。