

平成 22 年 2 月 3 日  
内閣府経済社会総合研究所  
国民経済計算部

## 平成 21 年 10～12 月期四半期別 GDP 速報における 季節調整法の設定変更について

国民経済計算の季節調整法については、米国商務省センサス局法 X-12-ARIMA を利用している。

異常値・レベルシフト調整、及び ARIMA モデル型（モデルの階差、次数）については原則として毎年の年次推計の際に行っているが、経済実態に照らしてより適切な季節調整を行うために、平成 21 年 10～12 月期四半期別 GDP 速報（1 次速報）（2 月 15 日公表予定）において、以下の設定変更を行う予定である。

### 記

対象系列： 財貨の輸出、財貨の輸入（名目・実質）

設定変更内容： 平成 20 年秋以降の大きな変動に対して異常値・レベルシフト調整を行うとともに、それを踏まえた ARIMA モデル型の再設定を行う。

(参考)

10～12 月期四半期別 GDP 速報（1 次）において適用される異常値・レベルシフト調整の設定内容は、10～12 月期までの系列に基づき決定されるが、参考までに 7～9 月期までの系列に対し、下記の異常値・レベルシフト調整を行った場合の結果は別添の通り。

採用する回帰変数：Ramp（X-12-ARIMA 組み込み）

$$Ramp[t_0, t_1] = \begin{cases} -1 & t \leq t_0 \\ (t - t_0) / (t_1 - t_0) - 1 & t_0 < t < t_1 \\ 0 & t \geq t_1 \end{cases}$$

ただし、 $t_0$  はデータの傾斜的変化の始期、 $t_1$  は終期。ここ

では  $t_0$  を 20 年 10～12 月期、 $t_1$  を 21 年 4～6 月期とした。

なお、実質 GDP 前期比に与える影響を試算したところ以下の通り。

	GDP前期比 への影響
2007/ 4- 6.	0.3%
7- 9.	0.2%
10- 12.	-0.3%
2008/ 1- 3.	-0.4%
4- 6.	0.6%
7- 9.	0.2%
10- 12.	-0.4%
2009/ 1- 3.	-0.2%
4- 6.	0.5%
7- 9.	0.1%
2008暦年	0.0%
2008年度	0.1%

(別添)

