



2023年10—12月期四半期別GDP速報（2次速報値） における推計方法の変更について

令和6年2月28日
内閣府経済社会総合研究所
国民経済計算部

季節調整について

新型コロナウイルス感染症の影響を考慮して設定してきた異常値処理のダミー変数は、2023年7—9月期四半期別GDP速報（2次速報値）以降、速報期間である2023年1—3月期以降の期間について、統計委員会国民経済計算体系的整備部会における議論¹を踏まえ、当面の間、外れ値の判定に用いる信頼区間を95%から99%に変更したうえで加法型異常値処理のダミー変数を設定する²。設定したダミー変数については、毎回の四半期別GDP速報の公表時に併せて公表する。

なお、速報期間（2023年1—3月期以降）の処理は、暫定的な処理であり、この手法により設定したダミー変数の取り扱いについては、2023年国民経済計算年次推計を反映する2024年7—9月期四半期別GDP速報（2次速報値）において、再度検証する³。

（以上）

¹ 統計委員会第35回国民経済計算体系的整備部会 資料2（令和5年10月30日）参照。

https://www.soumu.go.jp/main_content/000909145.pdf

² 2022年7—9月期四半期別GDP速報（2次速報値）以降、速報期間である2022年1—3月期以降の期間について、先験的な形では設定せず、各速報推計時点で、X-12-ARIMAの予測系列から外れ値となる場合に暫定的なダミーを設定していた。具体的には、2022年1—3月期以降の各期において、その前期を起点とした予測系列で95%信頼区間を外れた場合に、加法型異常値処理のダミー変数を設定していた。

³ 各期の2次速報値の推計において設定した異常値処理は、原則として、2024年7—9月期四半期別GDP速報（1次速報値）までは変更しない。2023年10—12月期四半期別GDP速報（1次速報値）において設定した速報期間（2023年1—3月期以降）のダミー変数については、2023年10—12月期四半期別GDP速報（1次速報値）「結果の概要」資料を参照。

https://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/data/data_list/sokuhou/files/2023/qe234/pdf/gaiyou2341.pdf