

# 別表 季節調整用ARIMAモデル設定一覧

## 1. GDP需要項目等

### (1) GDP需要項目

系列 (いずれも名目、実質共通)	ARIMAモデル型	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 (除く帰属家賃)	(010)(011)		VAT97 (注1)	平成9年4月の消費税率引き上げ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ちょうど逆に効くように設定。
国内家計最終消費支出 (帰属家賃分)	(112)(012)	x	(なし)	
居住者家計の海外での直接購入	(010)(011)	x	(なし)	
非居住者家計の国内での直接購入	(010)(011)	x	(なし)	
政府個別消費支出	(110)(011)	x	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。
政府集合消費支出	(110)(011)	x	(なし)	
民間住宅	(011)(011)	x	(なし)	
民間企業設備	(010)(010)	x	(なし)	
公的住宅	(010)(110)	x	(なし)	
公的企業設備	(010)(010)	x	(なし)	
一般政府総固定資本形成	(211)(012)	x	(なし)	
民間製品在庫品増加	(112)(012)	x	VAT97 (注1)	平成9年4月の消費税率引き上げ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ちょうど逆に効くように設定。
民間什掛品在庫品増加	(110)(110)	x	(なし)	
民間流通在庫品増加	(010)(110)	x	(なし)	
民間原材料在庫品増加	(110)(011)	x	(なし)	
公的企業在庫品増加	(012)(010)	x	(なし)	
一般政府在庫品増加	(011)(110)	x	(なし)	
財貨・サービスの輸出 (除く非居住者家計の国内での直接購入)	(010)(011)	x	(なし)	
財貨・サービスの輸入 (除く居住者家計の海外での直接購入)	(011)(011)	x	(なし)	
海外からの所得の受取	(010)(011)	x	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、本来なら本項目に計上されないはずの「金融派生商品」分が控除できないため、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	(010)(011)	x	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、本来なら本項目に計上されないはずの「金融派生商品」分が控除できないため、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。

(注1) VAT97は当方で定義した変数であり、1997.1=1、1997.2=-1、他の期は0と設定。

(注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。

### (2) 推計過程上、X-12-ARIMAによる季節調整が必要な系列

系列	ARIMAモデル型	閏年調整 (lpyear)	異常値・レベルシフト	
			種類, 期	設定理由
民間設備投資 (供給側推計値)	(012)(010)	x	(なし)	
民間設備投資 (需要側推計値)	(010)(010)	x	(なし)	

## 2. 雇用者報酬系列

系列	ARIMAモデル型	閏年調整 (lpyear)	異常値・レベルシフト	
			種類, 期	設定理由
雇用者報酬 (名目) 系列				
賃金・俸給	(010)(010)	x	(なし)	
雇主の現実社会負担	(212)(011)	x	(なし)	
雇主の帰属社会負担	(212)(010)	x	(なし)	