

昭和 55 年までの遡及結果（平成 12 年基準）の四半期別 GDP 速報への反映について

平成 21 年 7 月 8 日に公表した平成 12 年基準による昭和 55 年までの遡及結果（以下『遡及結果』とする）については、平成 21 年 8 月 17 日（月）公表予定の平成 21 年 4-6 月期 1 次速報より四半期別 GDP 速報（以下『QE』とする）へ反映する。具体的には以下のとおり。

（「平成 19 年度国民経済計算（12 年基準・93SNA）-昭和 55 年までの遡及結果含む-」については、<http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/h19-kaku/21annual-report-j2.html> を参照のこと。）

（1）原系列について

『遡及結果』の反映に伴い、平成 21 年 4-6 月期 1 次速報における遡及改定期間は最大以下のとおりとなる。（イ）については、今後、当面の間、遡及改定は行われず。（ロ）については、毎回の『QE』に利用する基礎統計の遡及改定期間によることとなる。

- （イ） 名目、実質ともに昭和 55 年 1-3 月期から平成 10 年 10-12 月期まで（遡及結果の遡及改定期間）
- （ロ） 名目においては、平成 19 年 1-3 月期から平成 21 年 1-3 月期まで、実質においては、平成 18 年 1-3 月期から平成 21 年 1-3 月期まで（『QE』における遡及改定期間）

（『QE』における遡及改定については、「四半期別 GDP 速報「QE」の推計方法」（平成 18 年 7 月改定）http://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/qe_manu/060712/honbun.pdf を参照のこと。）

（2）季節調整系列について

（1）のとおり原系列の『遡及結果』反映を受けて、季節調整モデルの再選定、季節調整のかけ直しを行う。

なお、需要項目のうち、国内家計最終消費支出（耐久財、非耐久財、半耐久財、サービス）（除く持ち家の帰属家賃）、民間企業設備、民間在庫品増加（原材料在庫、仕掛品在庫、製品在庫、流通在庫）については、昭和 55 年から平成 5 年までと平成 6 年以降では、資料の制約のため、異なる基礎資料を用いて四半期分割を行ったことから、季節調整についても①昭和 55 年から平成 5 年、②平成 6 年以降、に期間を分割してモデルの選定（期間

①のみ)、季節調整のかけ直しを行う。

これらをまとめると、季節調整系列のモデル選定期間及び改定期間は以下の(イ)、(ロ)のようになる。なお、各項目の季節調整モデル、ダミーの設定等については別紙のとおり。

(イ) 国内家計最終消費支出、民間企業設備、民間在庫品増加以外

<モデル選定期間>

名目、実質ともに、昭和55年1-3月期から平成18年10-12月期まで

<遡及改定期間>

名目、実質ともに、毎回、昭和55年1-3月期まで遡って改定される。

(ロ) 国内家計最終消費支出、民間企業設備、民間在庫品増加

<モデル選定期間>

① 昭和55年1-3月期から平成5年10-12月期まで

② 平成6年1-3月期から平成18年10-12月期まで（従来利用しているモデルと同じ）

<遡及改定期間>

名目、実質ともに、毎回、平成6年1-3月期まで遡って改定される。なお、昭和55年1-3月期から平成5年10-12月期までについては、今後、当面の間、遡及改定は行われぬ。

(別紙) 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、「四半期別GDP速報(QE)の推計方法(第5版)」(平成18年7月改定)を参照されたい。

(2) 季節調整モデルの見直しは原則毎年の年次推計の際に行うこととしているが、21年4-6月期1次QEにおいて、12年基準による昭和55年までの遡及結果(平成21年7月8日公表)を取り込み、原則昭和55年から直近期まで季節調整を行うこととしたため、モデルを見直した。

(3) なお、国内家計最終消費支出(耐久財、非耐久財、半耐久財、サービス(除く持ち家の帰属家賃))、民間企業設備、民間在庫品増加(原材料在庫、仕掛品在庫、製品在庫、流通在庫)については、昭和55年から平成5年までと平成6年以降では、資料の制約のため、異なる基礎資料を用いて四半期分割を行ったことから、季節調整についても①昭和55年から平成5年、②平成6年以降、に期間を分割している。

(4) 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。

1. GDP需要項目(昭和55年1-3月期~直近期)

(1) 以下の季節調整モデルは昭和55年1-3月期~直近期に適用するもの。ただし、同一系列において①、②を付しているのは、上述のとおり季節調整期間を分けているものであり、①は昭和55年1-3月期~平成5年10-12月期、②は平成6年1-3月期~直近期に適用するもの。

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①	(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ちょうど逆に効くように設定。
耐久財②	(0 1 0)(0 1 1) (0 1 1)(0 1 1)	×	VAT97(注)	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。
半耐久財①	(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ちょうど逆に効くように設定。
半耐久財②	(2 1 2)(0 1 1) (2 1 2)(0 1 1)	×	VAT97(注)	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。
非耐久財①	(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ちょうど逆に効くように設定。
非耐久財②	(0 1 1)(2 1 0) (0 1 2)(2 1 2)	×	VAT97(注)	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。
サービス(除く持ち家の帰属家賃)①	(2 1 2)(2 1 0) (2 1 2)(2 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ちょうど逆に効くように設定。
サービス(除く持ち家の帰属家賃)②	(0 1 0)(0 1 1) (0 1 0)(0 1 1)	×	VAT97(注)	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。
サービス(持ち家の帰属家賃)	(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	(2 1 2)(1 1 2) (0 1 0)(2 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	(0 1 0)(2 1 1) (0 1 0)(2 1 1)	×	LS1985.4	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、1年間にわたりレベルシフト調整変数を設定。
			LS1986.4	
			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。
			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。
			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	(0 1 1)(0 1 1) (1 1 0)(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	(0 1 1)(1 1 1) (0 1 1)(0 1 1)	×	(なし)	
民間住宅	(0 1 2)(0 1 1) (0 1 2)(1 1 1)	×	(なし)	

民間企業設備①	(212)X(011) (112)X(110)	×	(なし)	
民間企業設備②	(110)X(210) (110)X(210)	×	(なし)	
公的住宅	(212)X(211) (211)X(111)	×	(なし)	
公的企業設備	(212)X(111) (212)X(012)	×	(なし)	
一般政府総固定資本形成	(211)X(110) (211)X(110)	×	(なし)	
民間原材料在庫品増加①	(202)X(201) (000)X(201)	×	(なし)	
民間原材料在庫品増加②	(102)X(101) (102)X(101)	×	(なし)	
民間仕掛品在庫品増加①	(002)X(100) (002)X(100)	×	(なし)	
民間仕掛品在庫品増加②	(200)X(200) (202)X(200)	×	(なし)	
民間製品在庫品増加①	(202)X(200) (202)X(200)		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ちょうど逆に効くように設定。
民間製品在庫品増加②	(102)X(101) (102)X(101)	×	VAT97(注)	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。
民間流通在庫品増加①	(202)X(101) (200)X(101)			
民間流通在庫品増加②	(201)X(102) (100)X(101)	×	(なし)	
公的企業在庫品増加	(001)X(101) (101)X(000)	×	(なし)	
一般政府在庫品増加	(000)X(202) (000)X(202)	×	(なし)	
財貨の輸出	(012)X(111) (112)X(011)	×	(なし)	
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)X(011) (010)X(011)	×	(なし)	
財貨の輸入	(210)X(212) (212)X(112)	×	(なし)	
サービスの輸入(除く居住者家計の海外での直接購入)	(010)X(011) (010)X(011)	×	(なし)	
海外からの所得の受取	(212)X(011) (212)X(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	(211)X(112) (211)X(112)	×	LS1996.1	同上
形態別総固定資本形成	-	-	-	-
住宅	(012)X(011) (012)X(012)	×	(なし)	
住宅以外の建物及び構築物	(212)X(210) (212)X(210)	×	(なし)	
輸送用機械	(211)X(110) (112)X(110)	×	(なし)	
その他の機械設備等	(010)X(212) (010)X(212)	×	(なし)	
コンピュータ・ソフトウェア	(212)X(210) (110)X(210)	×	(なし)	

(注)1. VAT89、VAT97は当方で定義した変数であり、それぞれ1989.1=1、1989.2=-1、1997.1=1、1997.2=-1とし、他の期は0と設定。

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

3. ARIMAモデル選定に用いるデータ期間は、①、②とあるものについては、①昭和55年1-3月期から平成5年10-12月期、②平成6年1-3月期から平成18年10-12月期までとした。

①、②については先行き予測8期、後戻り予測20期とした。それ以外については昭和55年1-3月期から平成18年1-3月期とし、先行き予測8期、後戻り予測はなしとした。

4. 民間企業設備及び一般政府総固定資本形成については、平成16年1-3月期の政府による民間部門からの大規模な資産購入を取り除いて季節調整を行っている。

(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	閏年調整 (pyear)	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)	(110)X(210)	×	(なし)	
民間設備投資(需要側推計値)	(110)X(210)	×	(なし)	

(注)ARIMAモデル推定期間は平成6年1-3月期-平成18年10-12月期。先行き予測8期、後戻り予測20期とした。

2. 名目雇用者報酬系列(昭和55年1-3月期～直近期)

以下の季節調整モデルは四半期別GDPの正式系列(昭和55年1-3月期～直近期)に適用しているものである。

系列	ARIMAモデル	閏年調整 (lpyear)	異常値・レベルシフト	
			種類、期	設定理由
賃金・俸給	(0 1 2 X 1 1 2)	×	(なし)	
雇主の現実社会負担	(1 1 0 X 0 1 0)	×	(なし)	
雇主の帰属社会負担	(1 1 1 X 1 1 1)	×	(なし)	

(注)ARIMAモデル推定期間は昭和55年1-3月期-平成18年10-12月期。後戻り予測はなし。

(参考)スペックファイルの例(名目国内家計最終消費支出(うち耐久消費財))

```
series { start =1994.1
  span =(1994.1,2009.2)
  modelspan =(1994.1,2009.2)
  period=4
  decimals =3
  precision =3}
transform { function=log }
arima { model = ( 0 1 0 )( 0 1 1 ) }
forecast { maxlead = 8
  maxback = 20 }
regression {
user = ( vat97 )
file = "xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx"
}
estimate { maxiter = 20000 }
x11{ savelog = q
  appendfcst = yes
  save = ( d11 d16 ) }
```