

2021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4年2月25日  
 内閣府経済社会総合研究所  
 国民経済計算部

1. 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2020年1-3月期以降の各四半期において設定してきた加法型異常値処理のダミー変数については、2021年12月8日公表の2021年7-9月期四半期別GDP速報（2次速報値）において、表1のとおり見直しを行っている<sup>1</sup>。加えて、2021年10-12月期については、1次速報推計時と同様に表2のとおり加法型異常値処理のダミー変数を設定する<sup>2</sup>。

（表1）

系列（名目及び実質）	X-12-ARIMAにおけるダミー変数
国内家計最終消費支出のうち	
耐久財	A02020. 1, A02020. 2, A02020. 3, A02021. 3
非耐久財	A02020. 2, A02020. 4
サービス（除く持ち家の帰属家賃、FISIM）	A02020. 1, TC2020. 2
居住者家計の海外での直接購入	A02020. 1, LS2020. 2
非居住者家計の国内での直接購入	A02020. 1, LS2020. 2
政府個別消費支出	A02020. 2, A02021. 2, A02021. 3
民間原材料在庫変動	A02020. 2
財貨の輸出	A02020. 2, A02020. 3
財貨の輸入	A02020. 2（名目のみ）, A02020. 3
形態別総固定資本形成のうち、輸送用機械	A02020. 2, A02021. 3
賃金・俸給（名目のみ）	A02020. 2, A02020. 3, A02020. 4

（表2）

系列（名目及び実質）	X-12-ARIMAにおけるダミー変数
国内家計最終消費支出のうち、耐久財	A02021. 4
政府個別消費支出	A02021. 4
形態別総固定資本形成のうち、輸送用機械	A02021. 4

なお、速報期間（2021年1-3月期）以降の処理は、暫定的な処理であり、こうしたダミー変数を残すか否かについては、第一次年次推計期間である2020年1-3月期から10-12月期に設定しているダミー変数の再検討と合わせて、2022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。

<sup>1</sup> 異常値を示す変数として、加法的外れ値(Additive Outlier: AO)、減衰的外れ値(Temporary Level Change: TC)、水準変化(Level Shift: LS)を設定している。

<sup>2</sup> 1次速報時にダミー変数を設定した系列に加え、2次速報で公表される形態別総固定資本形成のうち、輸送用機械についてもAOダミーを設定する。

## 2. 「農業構造動態調査結果」の公表遅延に伴う対応

民間在庫変動の推計に当たって、「農業構造動態調査」（農林水産省）を利用しているが、令和3年調査結果（確報）の公表が延期されているため、2021年10－12月期四半期別GDP速報（2次速報値）でも、1次速報推計時と同様、令和3年8月公表の第1報を用いて推計を行う。

（以上）