



2022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5年2月27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、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、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、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置く手法に変更している。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する。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（2022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を残すか否かについては、2022年国民経済計算年次推計を反映する2023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²。

（以上）

¹ 統計委員会第32回国民経済計算体系的整備部会資料1（令和4年10月19日）を参照。
（https://www.soumu.go.jp/main_content/000841092.pdf）

² 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、2023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。2022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（2022年1 - 3月期以降）のダミー変数については、2022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/2022/qe224/pdf/gaiyou2241.pdf）