

資料2 景気動向指数の 改定に関する参考資料集

目 次

(資料2 - 1) 景気動向指数採用系列の変遷	1
(資料2 - 2) 個別系列の改定について	2
(資料2 - 3) 景気動向指数採用系列の新旧対照表	3
(資料2 - 4) 個別系列の新旧対比グラフ	4
(資料2 - 5) 個別系列のパフォーマンス	11
(資料2 - 6) 「外れ値」処理手法の改善について	42
(資料2 - 7) 新たな「外れ値」処理手法の計算手順	48
(資料2 - 8) 現行C I、新「外れ値」処理C I及び「外れ値」処理なしC Iの比較	50
(資料2 - 9) 新旧C IとD Iのパフォーマンス	53
(資料2 - 10) 新旧C Iの対比グラフ	54
(資料2 - 11) 新旧D Iの対比グラフ	57
(資料2 - 12) 基調判断の基準	60
(資料2 - 13) 改定後の体系による過去の基調判断の推移	61
(資料2 - 14) 一致指数と基調判断の時系列グラフ	62

(資料2-1) 景気動向指数採用系列の変遷

	公表開始	第1次改定	第2次改定	第3次改定	第4次改定	第5次改定	第6次改定	第7次改定	第8次改定	第9次改定	第10次改定
	20系列 (1960年8月)	21系列 (1965年2月)	25系列 (1966年3月)	25系列 (1968年6月)	25系列 (1979年5月)	30系列 (1983年8月)	32系列 (1987年7月)	30系列 (1996年6月)	30系列 (2001年12月)	29系列 (2004年11月)	28系列 (2011年11月)
先行系列	外貨準備高(除米市銀特別借入れ)	((外貨準備高))				取引条件指数	収益環境指数(製造業) 投資環境指数(製造業)				
	全銀設備資金新規貸付件数	全銀設備資金新規貸出(含信託勘定)			日経商品指数(総合、42種)			((17種))	((42種))		((水準値))
	機械受注(製造業)	((海運を除く民需))			((船舶・電力除く民需))			実質機械受注(船舶・電力除く民需)			
	建設受注(民間)	建設受注(民間)				建設財出荷指数	建設工事手持月数				
	臨時日雇労働者延人員				原材料在庫率指数(製造業)			(2001年1月より内閣府算出)	生産財在庫率指数(鉱工業)		
	入職率(製造業)					新設住宅着工戸数	新設住宅着工床面積				
	所定外労働時間(製造業)					新車新規登録台数(乗用車)	耐久消費財出荷指数	新車新規登録・届出台数(乗用車)	耐久消費財出荷指数		
	総実労働時間(全産業)						新規求人数(除学卒)				
	企業整備事業所数	企業倒産件数					銀行取引停止処分件数			消費者態度指数	
	東証株価指数(旧指数)				((総合))					東証株価指数	((水準値))
一致系列	輸入通関実績(総額)				((数量ベース))						
	生産指数(製造業)	((鉱工業))									
	生産者出荷指数(製造業)	((鉱工業))									
	原材料消費指数(製造業)	原材料消費指数(製造業)							(2001年1月より内閣府算出)	生産財出荷指数(鉱工業)	
	稼働率指数(製造業)										耐久消費財出荷指数
	建築着工床面積(鉱工業)										
	所定外労働時間(製造業)										
	新規求人数(除学卒)	(1966年10月)									
	労働投入量指数(製造業)										
	投資財出荷指数(除輸送機械)										
遅行系列	国鉄貨物輸送トン数	((トンキロ))			(1966年10月)	国内貨物輸送量(合計)					
	現金通貨残高										
	手形交換高(東京)										
	卸売物価指数(総合)										
	卸売物価指数(卸売業)										
	商業販売額指数(卸売業)										
	商業販売額(小売業)										
	商業販売額(卸売業)										
	商業販売額(卸売業)										
	商業販売額(卸売業)										
先行系列	原材料在庫指数(製造業)								(2001年1月より内閣府算出)		
	製品在庫指数(製造業)	((鉱工業))									
	設備投資(機械受注残高)										
	日銀貸出金										
	全銀貸付率										
	全銀貸出約定平均金利										
	全銀貸出約定平均金利(総合ストック)										
	全銀貸出約定平均金利(総合ストック)										
	全銀貸出約定平均金利(総合ストック)										
	全銀貸出約定平均金利(総合ストック)										
先行系列	不渡手形枚数(東京)										
	預金通貨回転率										
	人件費比率(製造業)										
	単位労働コスト(製造業)										
	人件費比率(製造業)										
	家計消費支出(全国勤労者世帯)										
	常用雇用指数(製造業)										
	常用雇用指数(製造業)										
	雇用保険受給者数										
	完全失業率										

(注)
 1. ———— その時点で削除した系列を示す。
 2. ———— 現在も採用している系列を示す。
 3. (()) 同一系列であるが、概念(内容)の変更を行ったものを示す。
 4. - - - - - 一度削除されて、後に再び採用された系列を示す。
 5. ———— 逆サイクルの系列を示す。
 6. ■■■■■ 現行採用系列を示す。

(資料 2 - 2) 個別系列の改定について

1. 名目値系列の実質値系列への転換

	系列名	改定内容
一致	中小企業売上高（製造業）	「中小企業出荷指数（製造業）」に変更

2. 前年同月比系列の（季調済）水準値系列への転換

	系列名	改定内容
先行 一致	耐久消費財出荷指数	季調済水準値系列に転換 一貫性が強いことから、一致系列へ組み入れ
先行	日経商品指数（42種総合）	季節性の検証の結果、原系列のまま水準値系列に転換
先行	東証株価指数	季節性の検証の結果、原系列のまま水準値系列に転換

3. 生産部門（製造業関連指標）の比率の是正

	系列名	改定内容
一致	稼働率指数	他の生産関連指標との重複感があり、速報性に劣るため、除外
一致	所定外労働時間指数（製造業）	「調査産業計」へ範囲を拡大
遅行	常用雇用指数（製造業）	「調査産業計」へ範囲を拡大

4. その他

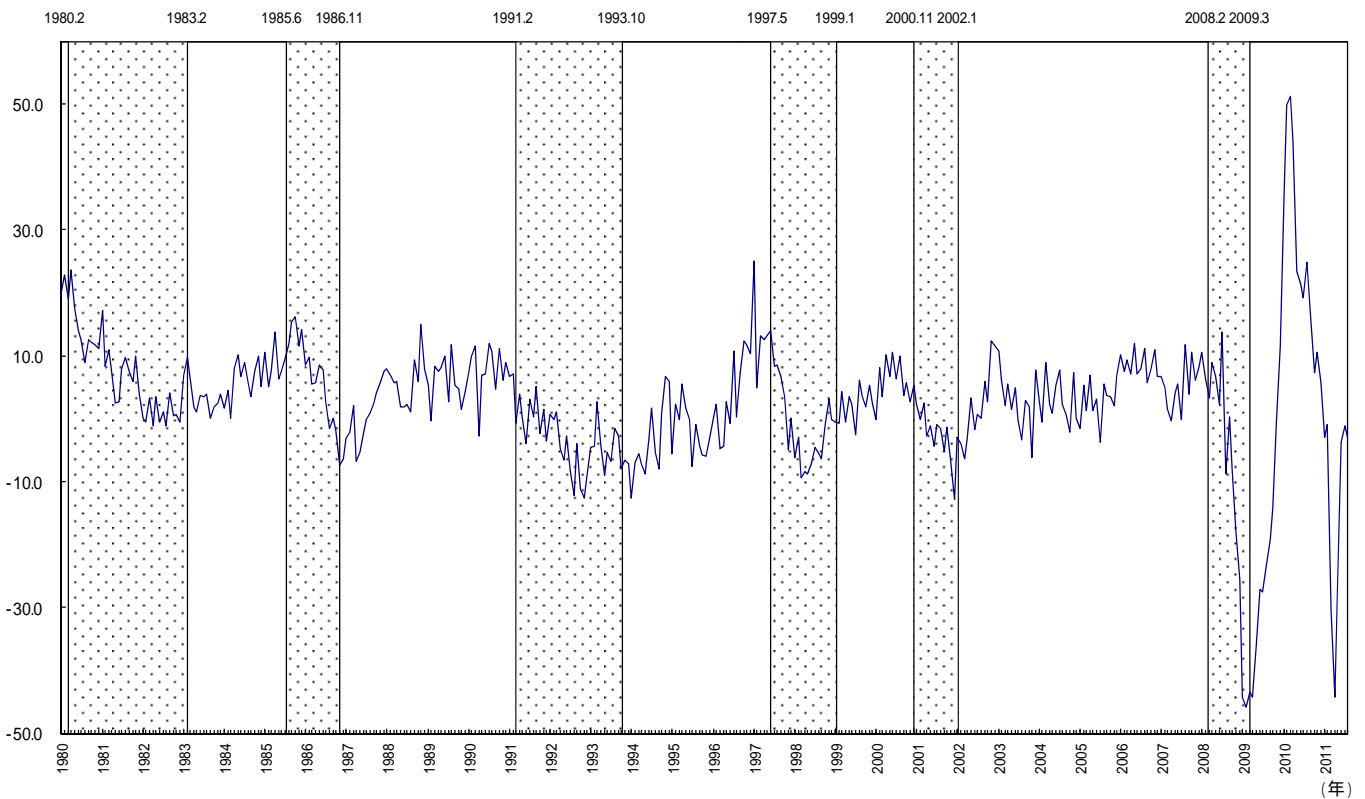
	系列名	改定内容
遅行	第3次産業活動指数(対事業所サービス業)	第3次産業活動指数の平成17年基準改定に合わせ、対事業所サービス業の定義を変更

(資料2 - 3) 景気動向指数採用系列の新旧対照表

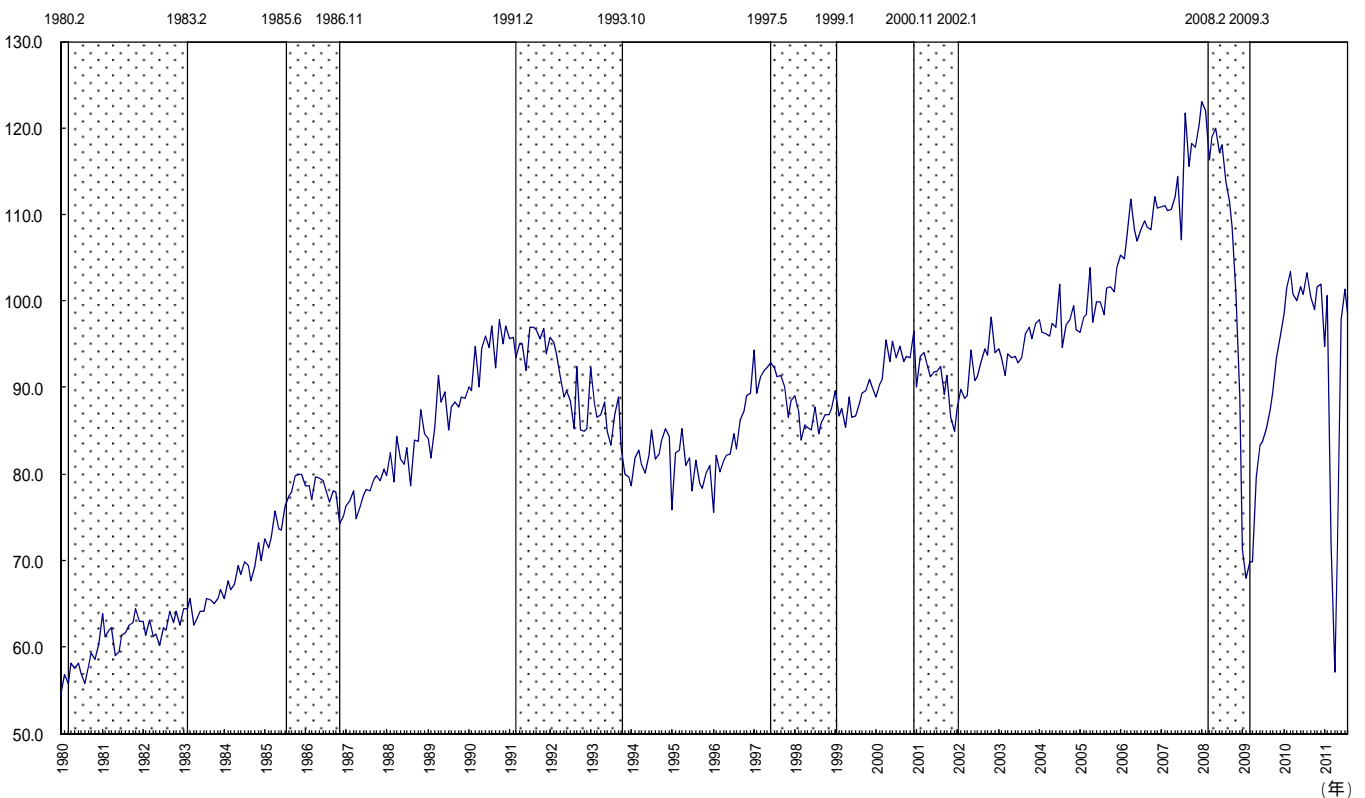
	旧系列	新系列
先行系列	1 最終需要財在庫率指数(逆) 2 鉱工業生産財在庫率指数(逆) 3 新規求人数(除学卒) 4 実質機械受注(船舶・電力除く民需) 5 新設住宅着工床面積 6 耐久消費財出荷指数(前年同月比) 7 消費者態度指数 8 日経商品指数(42種総合、前年同月比) 9 長短金利差 10 東証株価指数(前年同月比) 11 投資環境指数(製造業) 12 中小企業売上げ見通しD.I.	同左 同左 同左 同左 同左 除外 同左 日経商品指数(42種総合) 同左 東証株価指数 同左 同左
一致系列	1 生産指数(鉱工業) 2 鉱工業生産財出荷指数 3 大口電力使用量 4 稼働率指数(製造業) 5 所定外労働時間指数(製造業) 6 投資財出荷指数(除輸送機械) 7 商業販売額(小売業、前年同月比)) 8 商業販売額(卸売業、前年同月比) 9 営業利益(全産業) 10 中小企業売上高(製造業) 11 有効求人倍率(除学卒)	同左 同左 同左 除外 採用 耐久消費財出荷指数 所定外労働時間指数(調査産業計) 同左 同左 同左 同左 中小企業出荷指数(製造業) 同左
遅行系列	1 第3次産業活動指数(対事業所サービス) 2 常用雇用指数(製造業、前年同月比) 3 実質法人企業設備投資(全産業) 4 家計消費支出(全国勤労者世帯、名目、前年同月比) 5 法人税収入 6 完全失業率(逆)	同左(新定義) 常用雇用指数(調査産業計、前年同月比) 同左 同左 同左 同左 同左

(資料2 - 4) 個別系列の新旧対比グラフ

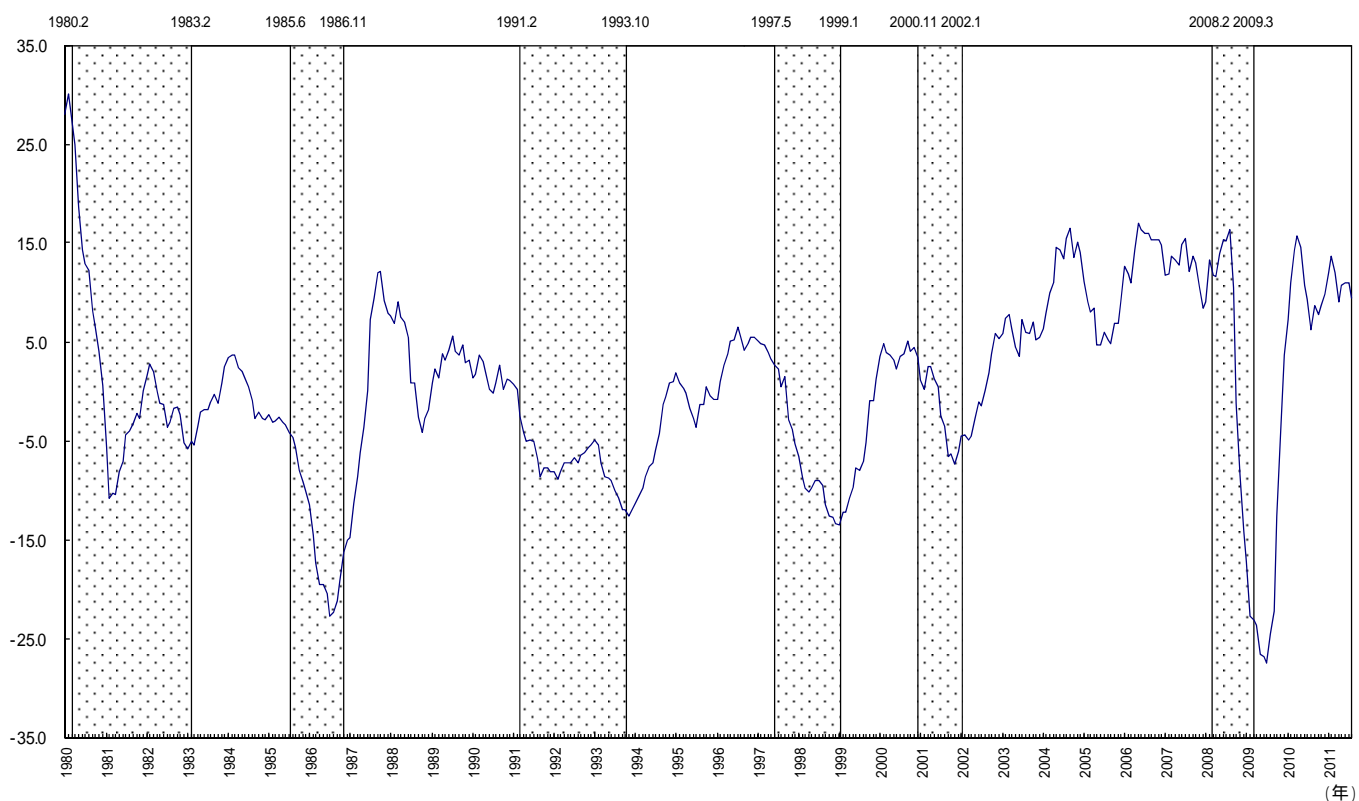
【先行系列】耐久消費財出荷指数（前年同月比）



【一致系列】耐久消費財出荷指数（季節調整値）



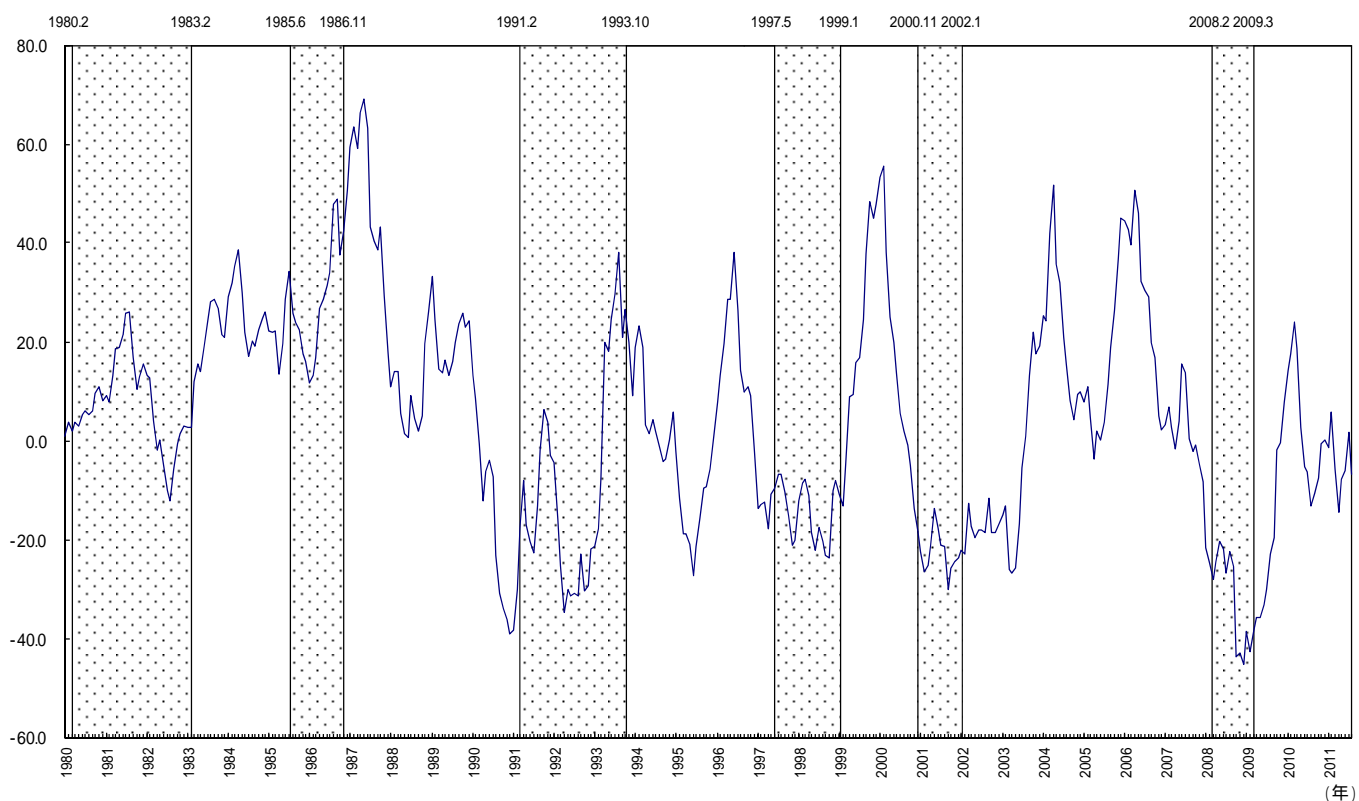
【先行系列】日経商品指数（42種総合）（前年同月比）



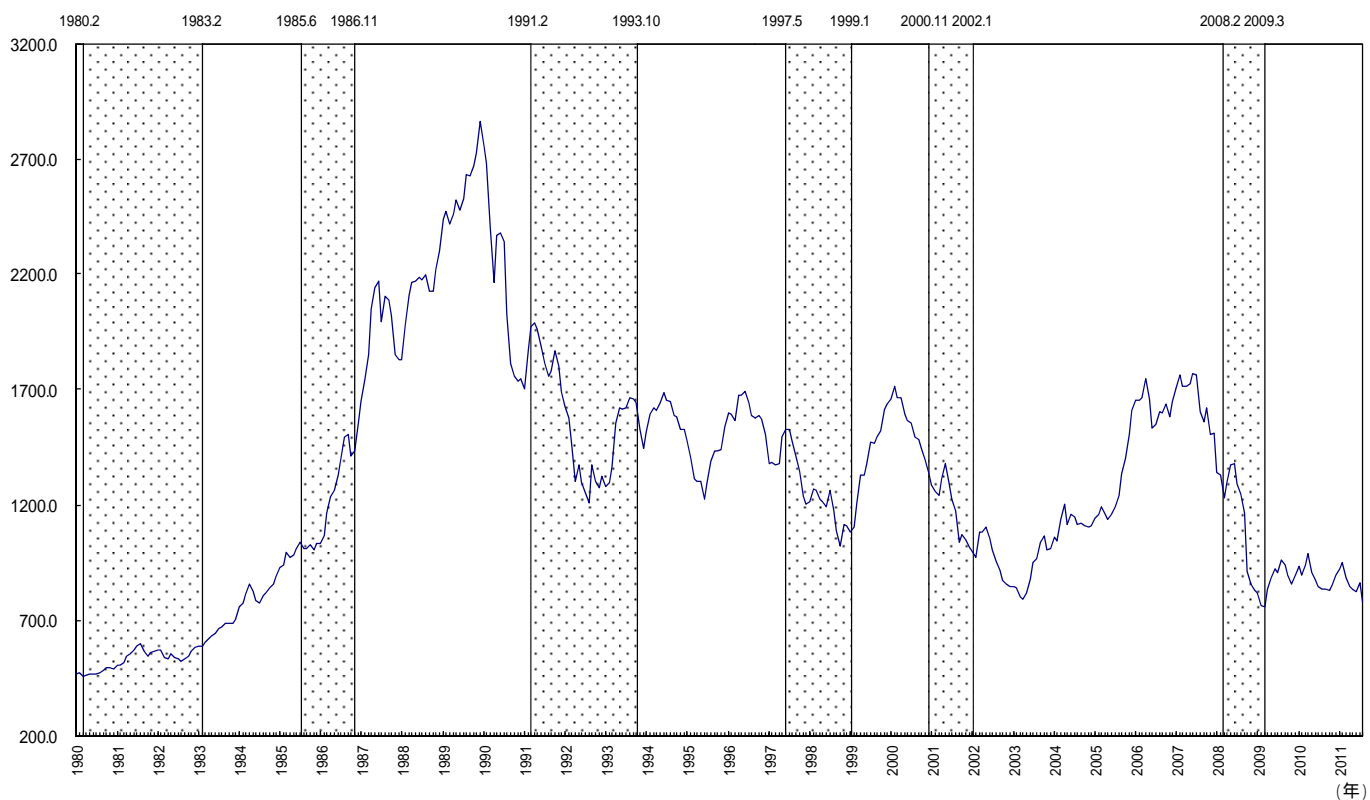
【先行系列】日経商品指数（42種総合）



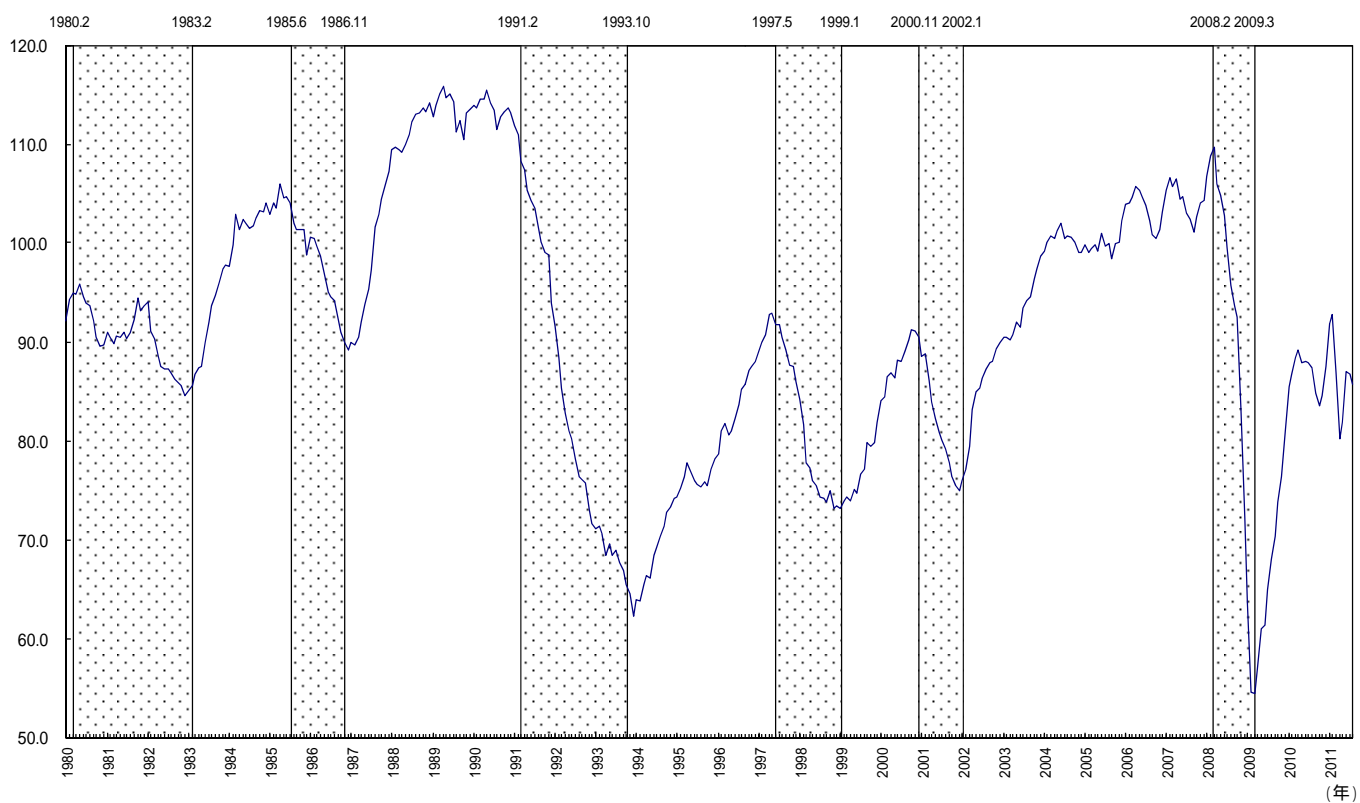
【先行系列】東証株価指数（前年同月比）



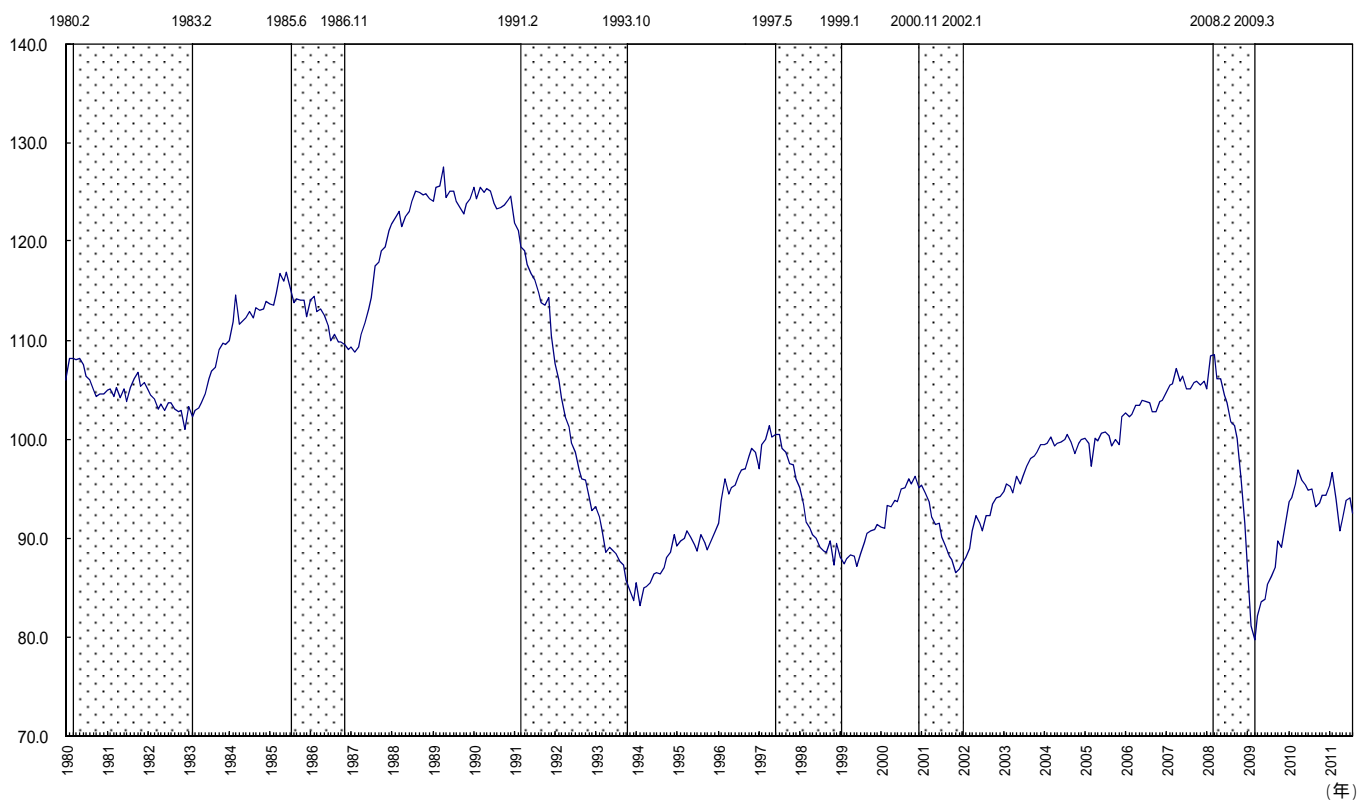
【先行系列】東証株価指数



【一致系列】所定外労働時間指数（製造業）



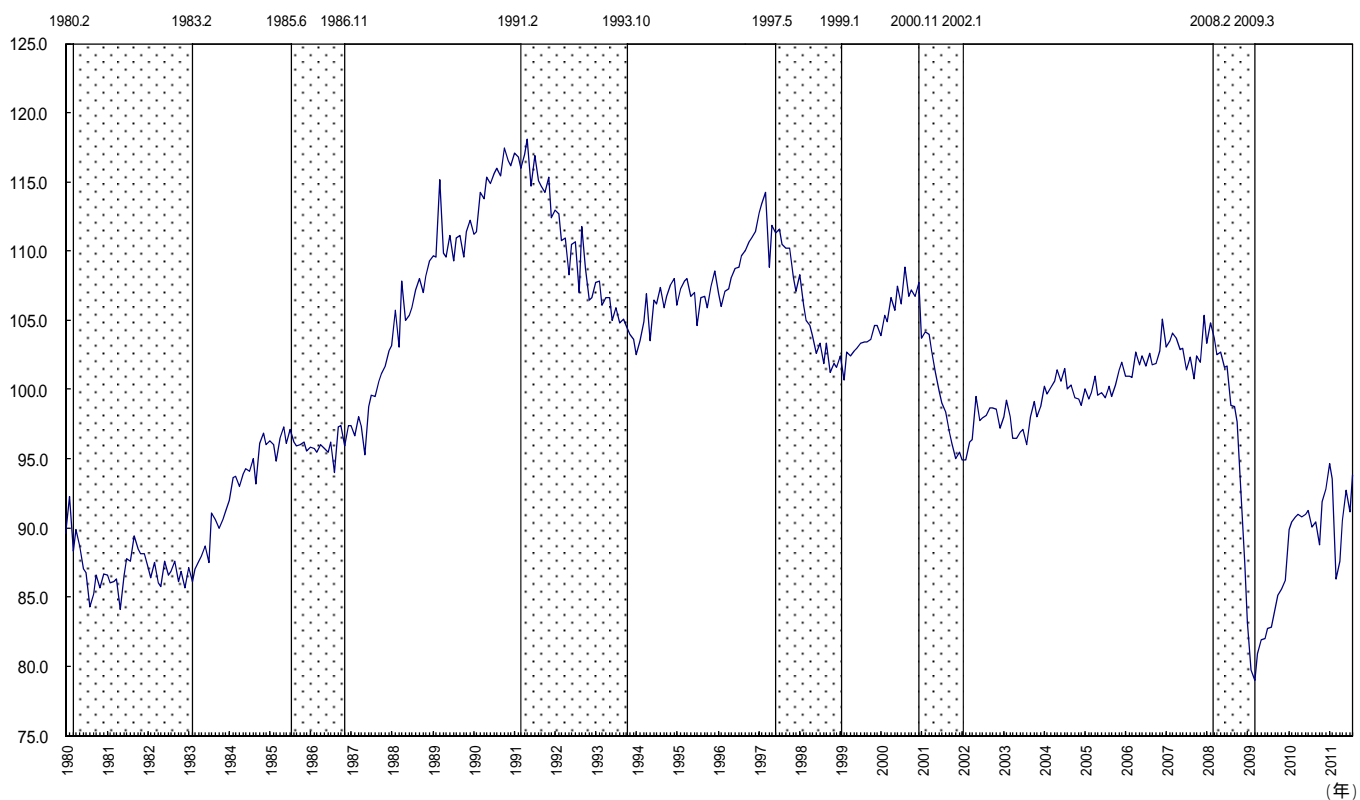
【一致系列】所定外労働時間指数（調査産業計）



【一致系列】中小企業売上高（製造業）



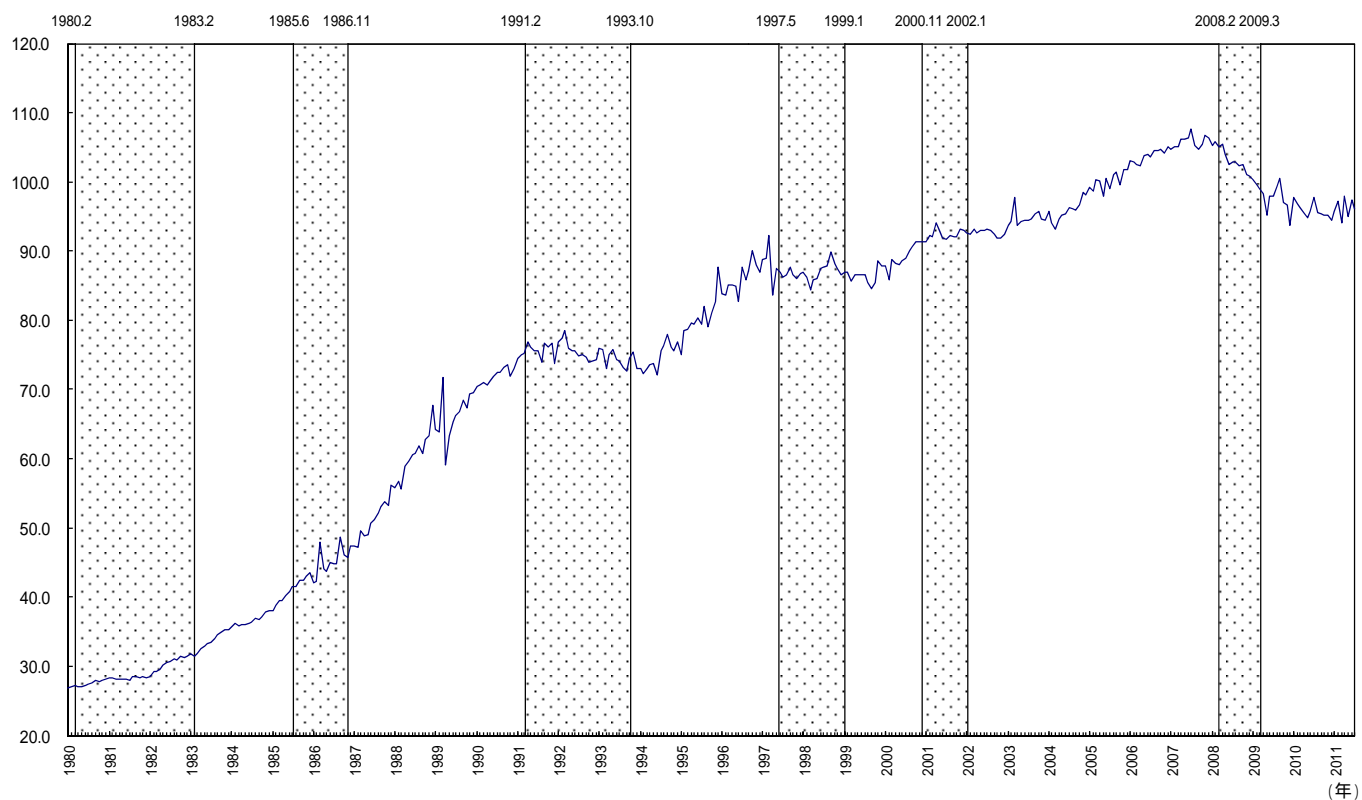
【一致系列】中小企業出荷指数（製造業）



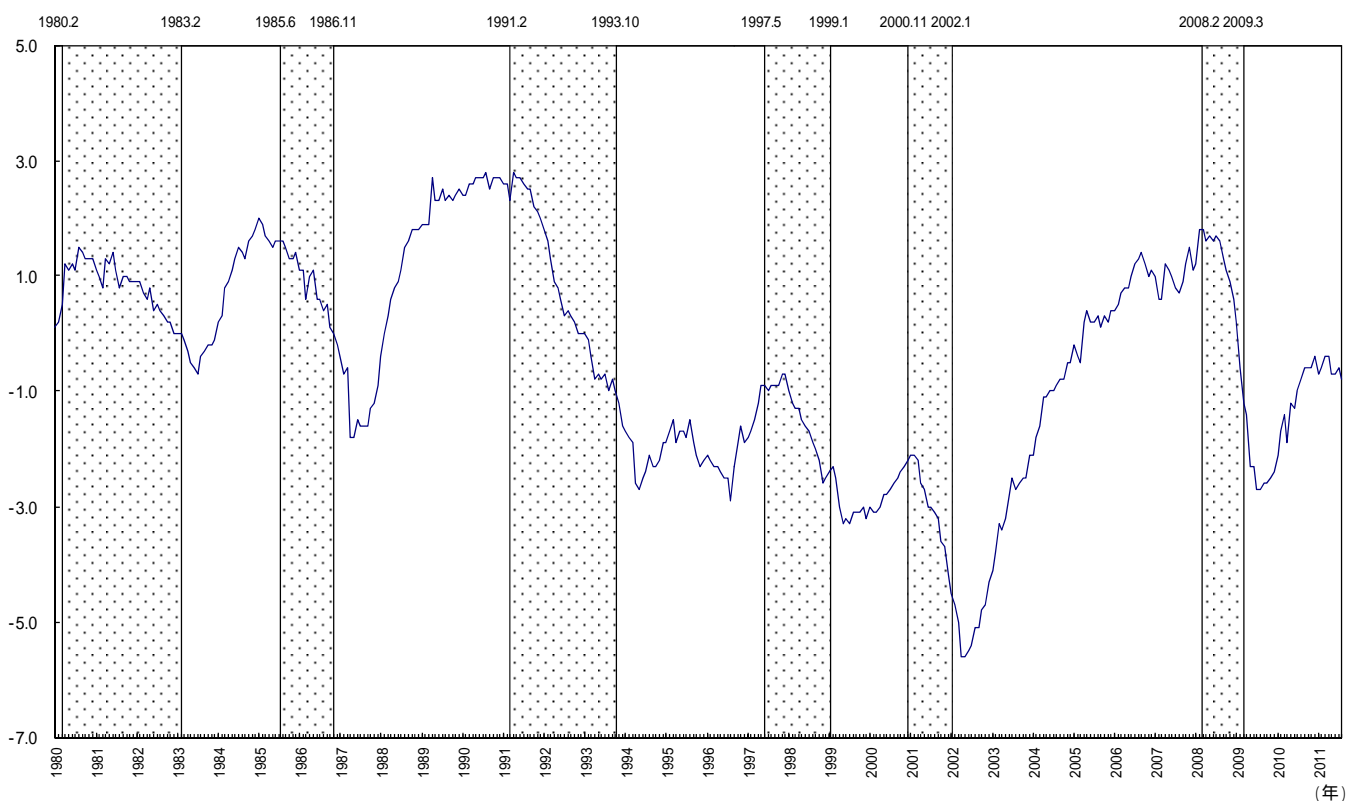
【遅行系列】第3次産業活動指数（旧定義による対事業所サービス業）



【遅行系列】第3次産業活動指数（対事業所サービス業）



【遅行系列】常用雇用指数（製造業）（前年同月比）



【遅行系列】常用雇用指数（調査産業計）（前年同月比）

