

第3次産業活動指数の平成22年年間補正における季節調整について

平成23年4月20日
経済産業省経済産業政策局
調査統計部経済解析室

第3次産業活動指数では、毎年2月分の公表において年間補正を実施している。平成22年については、第3次産業活動指数の低下及び上昇局面が季節指数の算出に影響を与える可能性があるため、昨年に続きその影響について検証を行った。その結果、異常値が検出されたため、年間補正において以下のとおり異常値の処理を行うこととした。

※年間補正…第3次産業活動指数(平成17年基準)では、当月を速報値、前月を暫定確報値、前々月を確報値とする「3か月運用」を採用している。年間補正は、この確報値の公表後に判明した報告値の修正など、当該年(今回は平成22年)の正しいデータが一年分そろった段階でその年の原指数を再計算し、さらにその系列を利用して季節指数を算出し確定する。併せて翌年分(平成23年)の暫定季節を算出する処理。

1. 異常値の検出方法及び対象

X-12-ARIMA の事前調整機能による異常値検出(加法的はずれ値:AO、レベルシフト:LS、一時的変化:TC)により異常値検出を行った。対象は、第3次産業活動指数の総合、13の大分類業種及び<運輸業>、<卸売業>など主要な特掲系列である。

2. 異常値の処理

上記の対象系列のうち、異常値が検出されたものについて異常値処理を行った。詳細は表1のとおり。

なお、平成20年及び21年で検出された異常値については、平成23年の暫定季節指数の算出のために異常値処理を行うが、これまで公表されている平成20年及び21年の原指数、季節調整済指数については平成22年年間補正の対象期間外であるため変更しない。

3. 異常値処理の結果

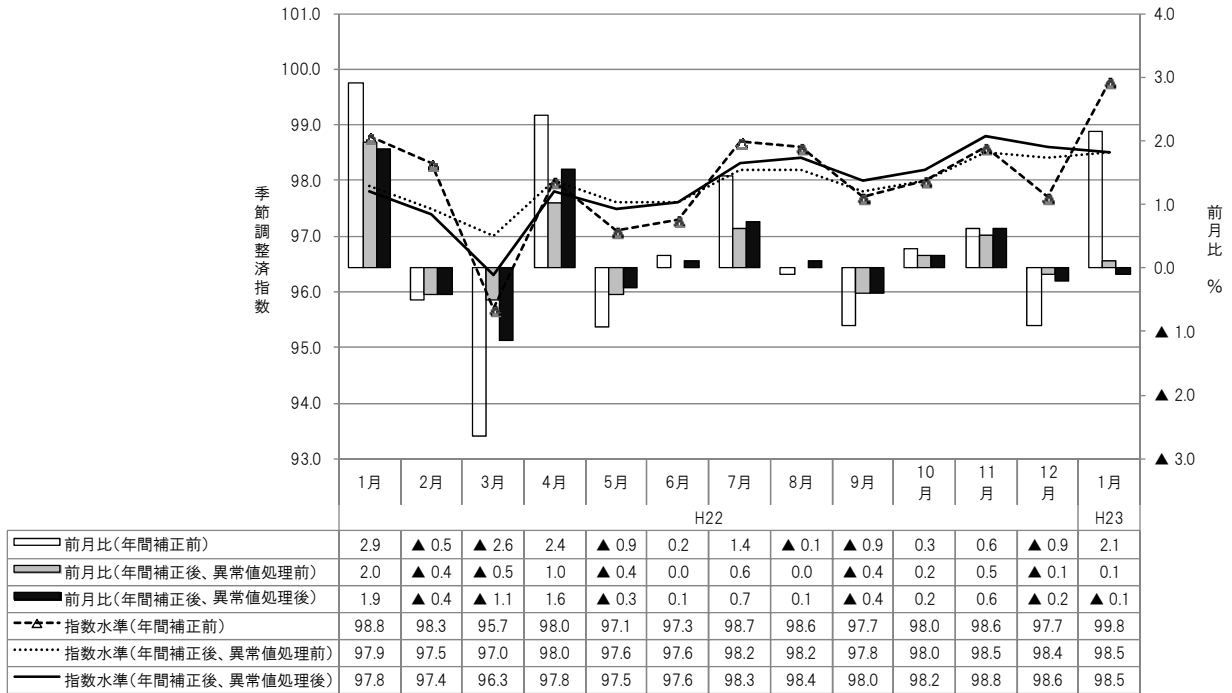
上記2. の異常値処理を行い、総合系列について年間補正前後を比較すると図1のとおり。

表1. 異常値を処理した系列及び各異常値

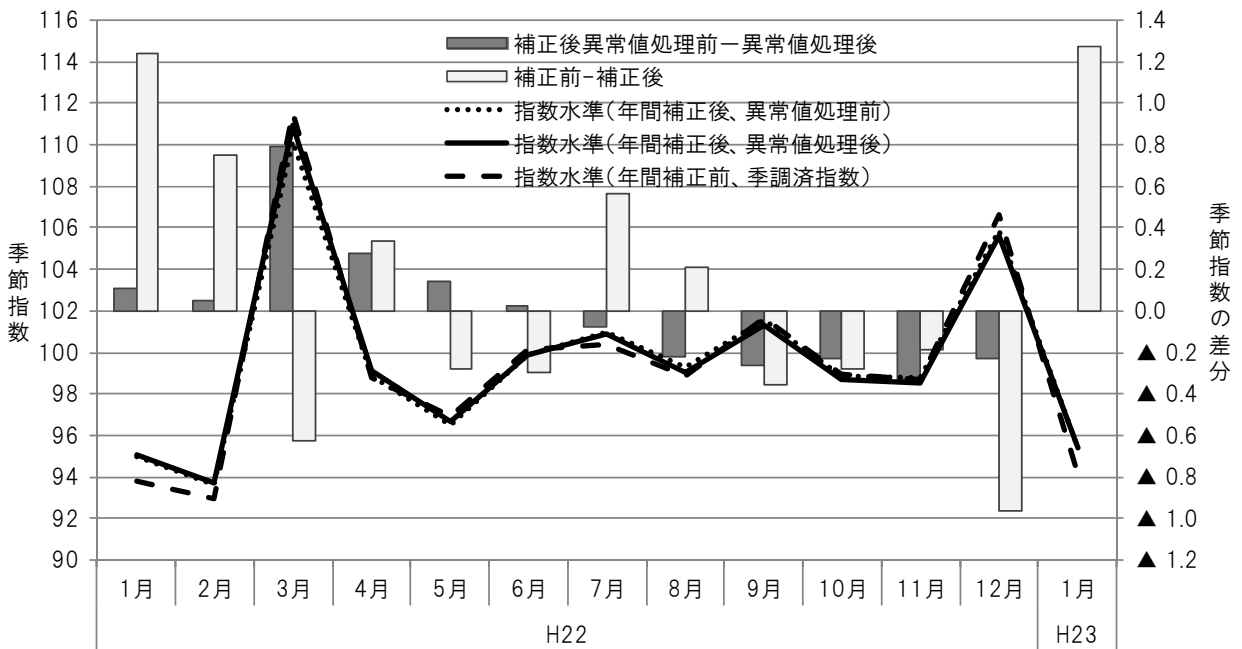
| 品目番号 | ITA名称 | 異常値種別 | 検出年月 |
|----------|---------------------------|-------|--------|
| T000000I | 第3次産業総合 | LS | 200901 |
| T000000I | | TC | 200903 |
| TH00000I | 運輸業, 郵便業 | TC | 200802 |
| TH00000I | | LS | 200812 |
| THA0000I | <運輸業> | LS | 200812 |
| TI00000I | 卸売業, 小売業 | TC | 200903 |
| TIA0000I | <卸売業> | TC | 200903 |
| TM00000I | 宿泊業, 飲食サービス業 | LS | 200901 |
| TTXD000I | <広義対事業所サービス> | TC | 200803 |
| TTXD000I | | LS | 200812 |
| TTXD000I | | LS | 200901 |
| TTXE000I | <観光関連産業> | LS | 200808 |
| TTXE000I | | LS | 200902 |
| TTXE000I | | AO | 200909 |
| UA00000I | 第3次産業及び公務等活動指数 | LS | 200901 |
| UA00000I | | TC | 200903 |
| UB00000I | 第3次産業総合(電気・ガス・熱供給・水道業を除く) | LS | 200901 |
| UB00000I | | TC | 200903 |

A0: 加法的はずれ値、LS: レベルシフト、TC: 一時的変化

図1. 第3次産業活動指数(総合)
 - 指数水準、前月比(%) -



- 季節指数 -



(注)上記季節指数には、曜日・祝祭日・うるう年指数を含む。