

ESRI Research Note No.1

「消費動向調査（全国、月次）」の調査方法の違い等による
かい離の問題と参考系列の作成について

by

橋本 由理子

June 2007



内閣府経済社会総合研究所
Economic and Social Research Institute
Cabinet Office
Tokyo, Japan

新 ESRI リサーチ・ノート・シリーズは、内閣府経済社会総合研究所内の議論の一端を公開するために取りまとめられた資料であり、学界、研究機関等の関係する方々から幅広くコメントを頂き、今後の研究に役立てることを意図して発表しております。

資料は、すべて研究者個人の責任で執筆されており、内閣府経済社会総合研究所の見解を示すものではありません。

なお、今後の修正が予定されるものであり、引用・転載を禁止いたします。

「消費動向調査（全国、月次）」の調査方法の違い等によるかい離の問題 と参考系列の作成について

橋本由理子*

2007 年 6 月

<概要>

「消費動向調査」は平成 16 年 4 月より月次調査化したが、訪問留置調査と電話調査を併用していた（平成 16~18 年度）ため、調査方法の違いによるかい離が生じた。さらに、連続する電話調査月間および世帯交替（新規世帯）に伴う調査慣れの影響も判明した。調査方法によるかい離と調査慣れの影響の補正方法を検討し、今後の調査結果と接続出来る参考系列の作成を試みた。

1. 消費動向調査について

「消費動向調査」は消費者の暮らし向きや収入の増え方などに関する考え方の変化を的確にとらえ、景気動向判断の基礎資料とすることを目的とし、内閣府で実施している調査である。昭和 32 年 9 月の第 1 回調査以来、調査内容の改定を経ながら毎年調査を継続し、昭和 52 年 6 月より「消費動向調査」として四半期毎に調査を実施してきた。また平成 8 年 3 月より「単身世帯消費動向調査」、平成 13 年 11 月より「月次消費動向調査（東京都）」を開始したが、平成 16 年 4 月からはこれらの調査を統合し、「消費動向調査」（全国、月次）（以下、「消費動向調査」という。）として毎月調査を実施している。調査の概要は以下の通りである（平成 19 年 4 月現在）。

- 調査対象 全国の世帯のうち、外国人・学生・施設入居世帯を除く約 4,500 万世帯
- 調査客体 一般世帯、単身世帯毎に三段抽出（市町村－調査単位区－世帯）により選ばれた 6,720 世帯（一般世帯 5,040 世帯、単身世帯 1,680 世帯）
- 調査時期及び調査方法 毎月 1 回年 12 回、調査客体の自計による訪問留置調査

*内閣府経済社会総合研究所景気統計部研究専門職(Email:yuriko.hashimoto@cao.go.jp)

参考系列の作成にあたっては、美添泰人・青山学院大学教授、鈴木督久・（株）日経リサーチ取締役から貴重なご助言をいただいた。また、検討段階においては樋口晋氏（内閣府）のご協力をいただいた。以上の方々に謝意を表する。なお、本稿に残された誤りは筆者の責任である。

○ 調査事項

- ・ 消費者の意識（毎月）
- ・ 物価の見通し（毎月）
- ・ 旅行の実績及び予定（6、9、12 及び3月）
- ・ 自己啓発、趣味、レジャー・サービス等の支出予定（6、9、12 及び3月）
- ・ 主要耐久消費財等の保有買替え状況（3月）
- ・ 世帯の状況（毎月）

なお、調査方法については平成 16～18 年度は訪問留置調査（6、9、12 及び3月）及び電話調査（それ以外の月）であったが、19 年度より毎月 1 回年 12 回の訪問留置調査へと変更した。

「消費動向調査」の代表的な指標に消費者態度指数がある。その作成方法は以下の通りである。

- （1）「暮らし向き」、「収入の増え方」、「雇用環境」及び「耐久消費財の買い時判断」の 4 項目に関し今後半年間の見通しについて 5 段階評価で回答してもらう。
- （2）5 段階評価のそれぞれ「良くなる」に（+1）、「やや良くなる」に（+0.75）、「変わらない」に（+0.5）、「やや悪くなる」に（+0.25）、「悪くなる」に（0）の点数を与え、この点数に各回答区分の構成比（%）を乗じ、乗じた結果を合計して、各項目ごとに消費者意識指標（原数値）を算出する。
- （3）これら 4 項目の消費者意識指標（原数値）を単純平均して消費者態度指数（原数値）を算出する。

2. 問題の所在

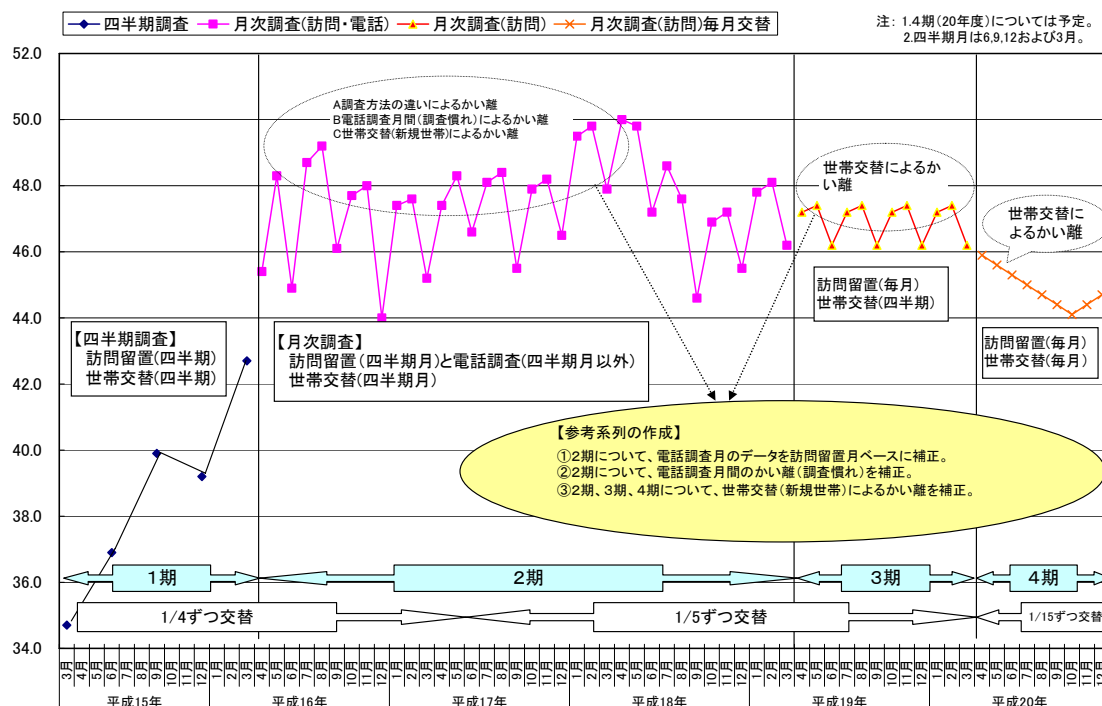
（1）調査方法の推移

「消費動向調査」の調査方法の推移を消費者態度指数（一般世帯、原数値）の動きでみると（図 1）、調査方法は 1 期～4 期に分けられる。1 期の四半期調査（6、9、12 及び3月）においては調査方法は訪問留置調査、また世帯交替は四半期毎に 1/4 ずつ交替（1 世帯の調査は 12 ヶ月継続）としていた。2 期（平成 16～18 年度）においては月次調査となり、調査方法は訪問調査（四半期月）と電話調査（四半期月以外）の併用とした。また世帯交替については四半期毎に 1/5 ずつ交替（1 世帯の調査は 15 ヶ月継続）に変更した。

2 期の消費者態度指数をみると、規則性のある上下の振れを伴う動きを示している。この振れ（＝かい離）の要因としては調査方法の違い、連続する電話調査月間の調査慣れ、世帯交替（新規世帯）の影響が考えられる。このかい離

により本来の目的である消費者の意識の基調的な動向を捉える事が困難になっていたため、3期（19年度）からは調査方法を毎月訪問留置調査に変更することとした。ただし、3期においても四半期毎の世帯交替によるかい離の影響は残ると予想されることから、これを平均化するため4期（20年度以降）においては世帯交替を毎月1/15とする予定としている。以降では、2期におけるかい離の要因について詳しくみていくこととする。

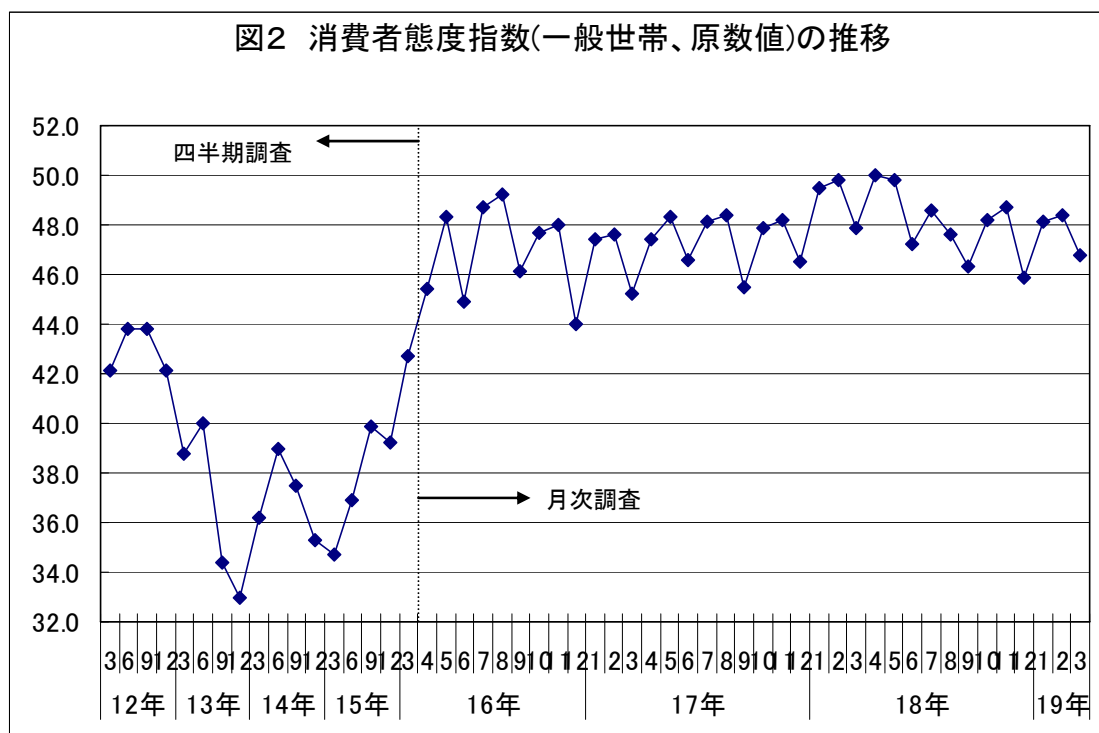
図1 調査方法別消費者態度指数（一般世帯、原数値）の推移



(2) 調査方法の違いによるかい離

「消費動向調査」の調査方法は前述のとおり、2期（平成16～18年度）においては3ヶ月に一度の訪問留置調査（四半期）と電話調査（それ以外の月）の、2つの調査方法を併用していた。その結果、電話調査月では訪問留置調査月と比較して消費者態度指数の水準が相対的に高くなる動きを示すことがわかった（図1）。

調査方法の違いにより調査結果にかい離が起こる原因としては、訪問留置調査では調査員が直接世帯を訪問するため（注：調査票をあらかじめ配布し、世帯が調査期間中に自ら回答を記入する方式である。）、世帯が調査票の記入に際し慎重で控え目な回答をする一方で、電話調査においては相手の顔が見えない気安さや回答の手軽さがあり、より楽観的な回答が多くなる傾向があるためと推測される。



(3) 連続する電話調査月の調査慣れの影響

平成16～18年度における調査方法は訪問留置調査からスタートし、訪問・電話・電話というパターンを繰り返す形となっていた。消費者態度指数の動きをこの調査方法のパターンと併せてみると、(2)の調査方法の違いによるかい離の差ほど顕著ではないものの、電話月調査では電話2ヶ月目の方が同1ヶ月目よりも水準が高くなる傾向を示している(図2)。このかい離の要因としては、「調査慣れ」が考えられる。同じ電話調査であっても1ヶ月目より2ヶ月目の方が調査方法に対する慣れのために余裕が生じ、世帯が前月の回答と比較してより前向きな回答を選択する傾向があるものと推測される。

(4) 世帯交替(新規世帯)における調査慣れの影響

調査世帯は15ヶ月間継続し、四半期毎に1/5ずつ交替するが(図3)、新規世帯のみ取り出し消費者態度指数を計算してみると、最初の3ヶ月のうち1ヶ月目は既存世帯を含む公表値より大幅に低く、その後かい離幅が徐々に小さくなり、ほぼ4ヶ月目から公表値と同じ水準になるという規則的な動きを示している(図2)。この要因としては、(3)と同様に「調査慣れ」が考えられる。最初の調査月では調査に不慣れなことから景気の先行きに懐疑的、悲観的な回答に傾くが、その後調査回数を重ねるにつれて、世帯を取り巻く状況や報道などで得られる社会の景気動向をより冷静に判断するようになること、前月の回答を念頭に置き、比較しながらの回答となることから、次第に公表値に近似した結果になるものと考えられる。

図3 消費者態度指数 電話調査月および新規世帯のかい離状況(一般世帯、原数値)

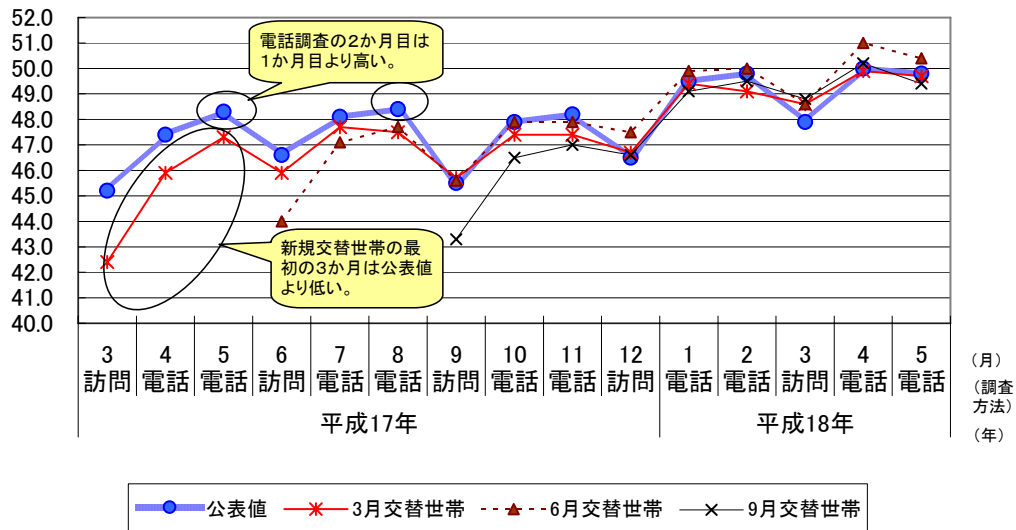
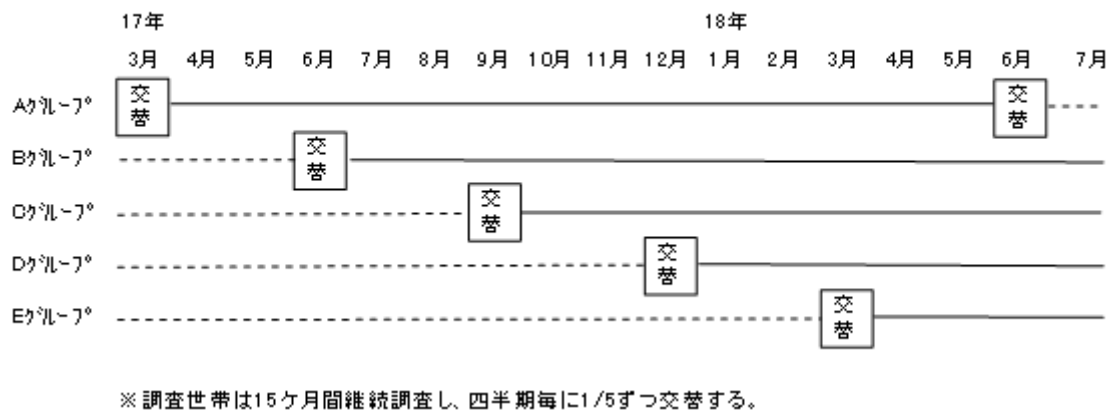


図4 世帯交替のイメージ



以上(2)～(4)の問題を踏まえ、平成16～18年度の間消費者態度指数の結果を補正して、今後の調査と接続出来る参考系列の作成を試みる。

3. 参考系列の作成

(1) 補正方法の検討

補正を要する要因について要約すると、次の3点となる。

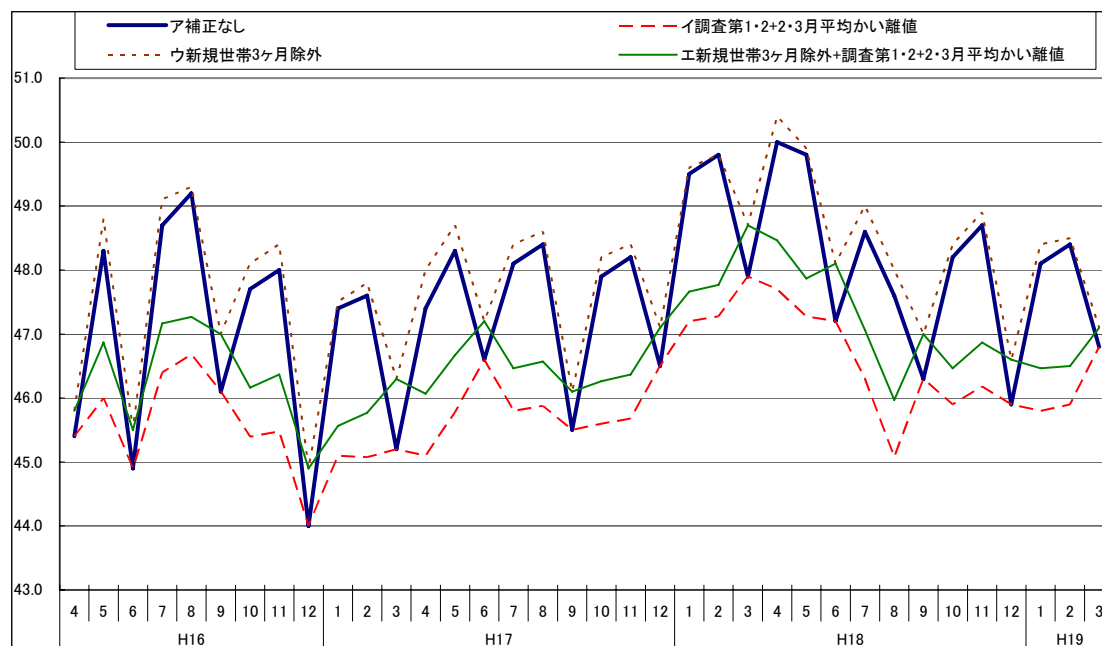
- A 調査方法の違い（訪問留置調査、電話調査）
- B 電話調査月間の調査慣れ（電話調査1ヶ月目、2ヶ月目）
- C 世帯交替（新規世帯の最初の3ヶ月）

このA～Cのかい離の補正方法の検討にあたり、消費者態度指数（一般世帯）について次の4通りの時系列データを作成した（以降では便宜的に訪問留置調査→調査第1月、電話調査1ヶ月目→調査第2月、電話調査2ヶ月目→調査第3月とする）。

- ア 補正なし
- イ 調査第1月・第2月の平均かい離値+調査第2月・第3月の平均かい離値による調査第2月・第3月の補正
- ウ 新規世帯の最初の3ヶ月間を除外
- エ イ+ウ

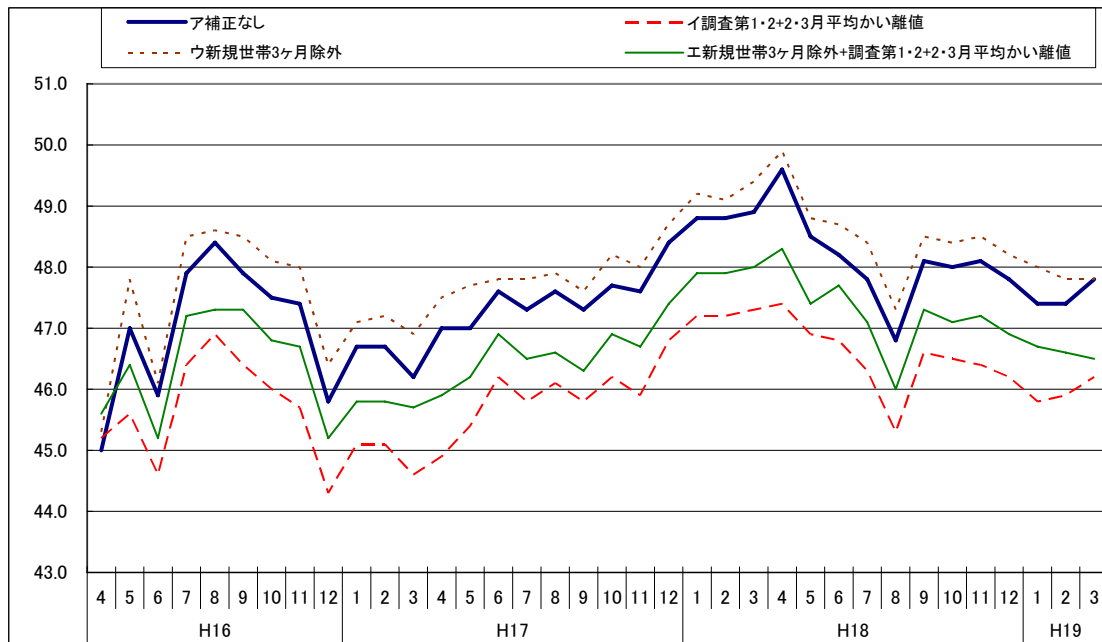
ア～エの時系列データ（原数値）をグラフ化したものが図5、さらに各系列を季節調整してグラフ化したものが図6である。

図5 補正方法別消費者態度指数の推移（一般世帯、原数値）



(注) 平成16年4月は訪問留置調査。

図6 補正方法別消費者態度指数の推移（一般世帯、季節調整値）



（注）平成16年4月は訪問留置調査。

また、補正方法と補正内容を整理したものが表1である。

表1 参考系列の補正方法と補正内容

	補正方法	計算方法	補正される内容
ア	補正なし	—	—
イ	調査第1月・第2月の平均かい離値＋調査第2月・第3月の平均かい離値	$b' = b - x1$ $c' = c - (x1 + x2)$	・ A、B が除去される。
ウ	新規世帯3ヶ月除外	—	・ C が除去される。
エ	新規世帯3ヶ月除外＋調査第1月・第2月の平均かい離値＋調査第2月・第3月の平均かい離値	$e' = e - y1$ $f' = f - (y1 + y2)$	・ A、B、C が除去される。

凡例：

<調査方法> 訪問留置調査月→調査第1月、電話調査1ヶ月目→調査第2月、電話調査2ヶ月目→調査第3月

<消費者態度指数データ> 調査第1月・第2月・第3月 a, b, c（下線は調査第1月）

新規世帯3ヶ月除外後調査第1月・第2月・第3月 d, e, f（下線は調査第1月）

<かい離値> 調査第1月・第2月の平均かい離値 $x1$ 、調査第2月・第3月の平均かい離値 $x2$

新規世帯3ヶ月除外後の消費者態度指数による調査第1月・第2月の平均かい離値 $y1$

新規世帯3ヶ月除外後の消費者態度指数による調査第2月・第3月の平均かい離値 $y2$

<かい離要因> A 調査方法の違い、B 電話調査月の調査慣れ、C 世帯交替(新規世帯3ヶ月)

かい離要因補正後の消費者態度指数について図 5、図 6 の各系列で比較すると、A、B、C の各種要因を除去したエの系列が 20 年度以降の調査方法と整合的で、安定の程度を増している。ただしこの方法では新規世帯の最初の 3 ヶ月間のデータが除外されるため、以下に述べる平均かい離値による補正により、参考系列を作成することとした。

(2) 平均かい離値補正による参考系列の作成
参考系列の作成手順は以下の通りである。

(C の補正)

イ) 平成 16～18 年度の間の各月の個票データを既存世帯と新規世帯（世帯交替から 3 ヶ月間）に分け、それぞれについて消費者態度指数を算出する。さらに調査方法別に分け平均値を求め、調査月別に既存世帯と新規世帯のかい離値を算出する。かい離値は調査第 1 月 3.21、調査第 2 月 1.53、調査第 3 月 1.03 となった。

ロ) 新規世帯の各月のデータに、イ) の平均かい離値を加算する。

ハ) 世帯交替割合に合わせ、既存世帯 $\times 4/5$ + 新規世帯 $\times 1/5$ として新規世帯かい離補正後の消費者態度指数を算出する。

(A+B の補正)

ニ) ハ) より調査方法別に平均値を求め、調査第 1 月－第 2 月、調査第 2 月－調査第 3 月の平均かい離値を算出する。かい離値は a 調査第 1 月－第 2 月 1.94 (A のかい離)、b 調査第 2 月－調査第 3 月 0.09 (B のかい離) となった。

ホ) ハ) のデータのうち調査第 2 月は第 2 月－a、調査第 3 月は第 3 月－(a+b) として調査第 1 月とのかい離値を補正する。

ヘ) ホ) で得られた参考系列（原数値）を季節調整し、参考系列（季節調整値）を算出する（表 2、表 3、図 7）。

表2 平均かい離値補正による消費者態度指数（一般世帯、原数値）の参考系列の作成

	①既存世帯と新規世帯別の消費者態度指数の算出、既存世帯と新規世帯の平均かい離値の算出						②新規世帯かい離値補正、③世帯交替割合による消費者態度指数の算出、④調査月間の平均かい離値の算出						⑤調査月間のかい離値補正
	既存世帯（4/5）			新規世帯			かい離補正後新規世帯（1/5）			計（5/5）			補正後原数値
	調査1	調査2	調査3	調査1	調査2	調査3	調査1	調査2	調査3	調査1	調査2	調査3	
16年 4月	45.8			44.2			47.4			46.2			46.2
5月		48.8			47.1			48.6			48.8		46.8
6月	45.5			43.0			46.2			45.7			46.7
7月		49.1			47.9			49.4			49.2		47.2
8月			49.3			48.9			49.9			49.5	47.4
9月	47.0			43.7			46.9			47.0			47.0
10月		48.1			46.7			48.2			48.1		46.2
11月			48.4			46.7			47.7			48.2	46.2
12月	44.9			41.1			44.3			44.8			44.8
17年 1月		47.5			47.1			48.6			47.8		45.8
2月			47.8			47.0			48.0			47.9	45.8
3月	46.3			41.8			45.0			46.0			46.0
4月		48.0			45.7			47.2			47.8		45.9
5月			48.7			47.2			48.2			48.6	46.6
6月	47.2			44.0			47.2			47.2			47.2
7月		48.4			47.1			48.6			48.4		46.5
8月			48.6			47.7			48.7			48.6	46.6
9月	46.1			43.3			46.5			46.2			46.2
10月		48.2			46.5			48.0			48.2		46.2
11月			48.4			47.0			48.0			48.3	46.3
12月	47.1			46.6			49.8			47.6			47.6
18年 1月		49.6			48.9			50.4			49.8		47.8
2月			49.8			49.9			50.9			50.0	48.0
3月	48.7			44.6			47.8			48.5			48.5
4月		50.4			48.4			49.9			50.3		48.4
5月			49.9			49.0			50.0			49.9	47.9
6月	48.1			42.6			45.8			47.6			47.6
7月		49.0			46.1			47.6			48.7		46.8
8月			48.0			46.1			47.1			47.8	45.8
9月	47.0			42.9			46.1			46.8			46.8
10月		48.4			46.9			48.4			48.4		46.5
11月			48.9			47.7			48.7			48.9	46.8
12月	46.6			42.5			45.7			46.4			46.4
19年 1月		48.4			47.1			48.6			48.4		46.5
2月			48.5			47.8			48.8			48.6	46.5
3月	47.1			45.4			48.6			47.4			47.4
平均値	46.72	48.66	48.75	43.52	47.13	47.73				46.72	48.66	48.75	
平均かい離値				3.21	1.53	1.03					1.94	0.09	

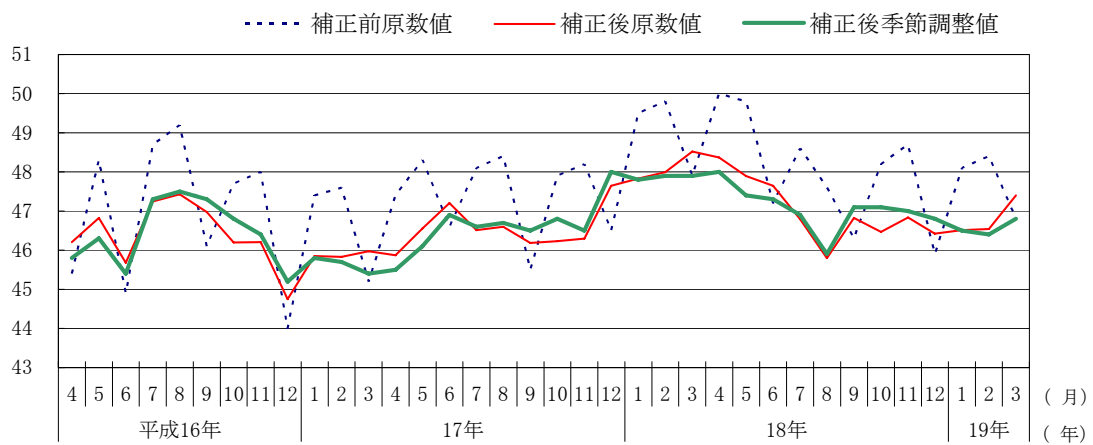
〔注〕 1. 平成16年4月調査は訪問留置調査。
2. 平成16年4月～平成17年5月の世帯交替は1/4。

表3 消費者態度指数の参考系列(一般世帯)

		補正前		補正後		
		原数値	原数値	季節調整値	前月差	季節指数
平成16年	4	45.4	46.2	45.8	-	100.80
	5	48.3	46.8	46.3	0.5	101.03
	6	44.9	45.7	45.4	▲ 0.9	100.66
	7	48.7	47.2	47.3	1.9	99.75
	8	49.2	47.4	47.5	0.2	99.76
	9	46.1	47.0	47.3	▲ 0.2	99.28
	10	47.7	46.2	46.8	▲ 0.5	98.68
	11	48.0	46.2	46.4	▲ 0.4	99.56
	12	44.0	44.8	45.2	▲ 1.2	99.15
17年	1	47.4	45.8	45.8	0.6	99.94
	2	47.6	45.8	45.7	▲ 0.1	100.11
	3	45.2	46.0	45.4	▲ 0.3	101.27
	4	47.4	45.9	45.5	0.1	100.80
	5	48.3	46.6	46.1	0.6	101.03
	6	46.6	47.2	46.9	0.8	100.66
	7	48.1	46.5	46.6	▲ 0.3	99.75
	8	48.4	46.6	46.7	0.1	99.76
	9	45.5	46.2	46.5	▲ 0.2	99.28
	10	47.9	46.2	46.8	0.3	98.68
	11	48.2	46.3	46.5	▲ 0.3	99.56
	12	46.5	47.6	48.0	1.5	99.15
18年	1	49.5	47.8	47.8	▲ 0.2	99.94
	2	49.8	48.0	47.9	0.1	100.11
	3	47.9	48.5	47.9	0.0	101.27
	4	50.0	48.4	48.0	0.1	100.80
	5	49.8	47.9	47.4	▲ 0.6	101.03
	6	47.2	47.6	47.3	▲ 0.1	100.66
	7	48.6	46.8	46.9	▲ 0.4	99.75
	8	47.6	45.8	45.9	▲ 1.0	99.76
	9	46.3	46.8	47.1	1.2	99.28
	10	48.2	46.5	47.1	0.0	98.68
	11	48.7	46.8	47.0	▲ 0.1	99.56
	12	45.9	46.4	46.8	▲ 0.2	99.15
19年	1	48.1	46.5	46.5	▲ 0.3	99.94
	2	48.4	46.5	46.4	▲ 0.1	100.11
	3	46.8	47.4	46.8	0.4	101.27

(注) 季節調整の方法はセンサス局法X11による。

図7 消費者態度指数の参考系列(一般世帯)



(注) 季節調整の方法はセンサス局法X11による。

図7のグラフで補正後の原数値および季節調整値をみると、補正前の原数値と比較して規則的な上下の振れが解消されて滑らかな動きとなっている。これにより消費者の意識の基調的な変動が把握し易くなるものと期待される。

なお、ここでは3年間のデータにより季節調整を行ってみたが、安定的な季節調整値を得るためには更に数年のデータの蓄積が必要である。

4. 今後の課題

3.の参考系列の作成では平成16～18年度の間消費者態度指数の結果の補正を試みたが、19年度以降のデータをどのように扱うか課題が残る。19年度より調査方法を毎月訪問調査に変更したため、調査方法の違い及び電話調査月間のかい離は解消されるものの、新規世帯のかい離については今後も持続する。一方調査方法のパターンは従来の訪問・電話・電話から訪問・訪問・訪問に変わる。調査方法の違いに世帯の意識は敏感に反応すること、また「調査慣れ」の進行も早まると予測されることから、新規世帯の消費者態度指数のかい離も従来パターンとは異なる可能性がある。19年度以降のデータに3.(2)の補正方法をそのまま適用すると、補正することで過剰なバイアスがかかる場合も考えられる。より適切な補正方法の検討および一層のデータの蓄積が必要である。

今後は毎月の調査から得られるデータを加味しつつ様々な角度から検討を続け、参考系列を景気判断及び統計ユーザーにとって有用となる指標として整備していく考えである。