

# AIを活用した経済指標予測

---

株式会社 大和総研  
2018年12月26日

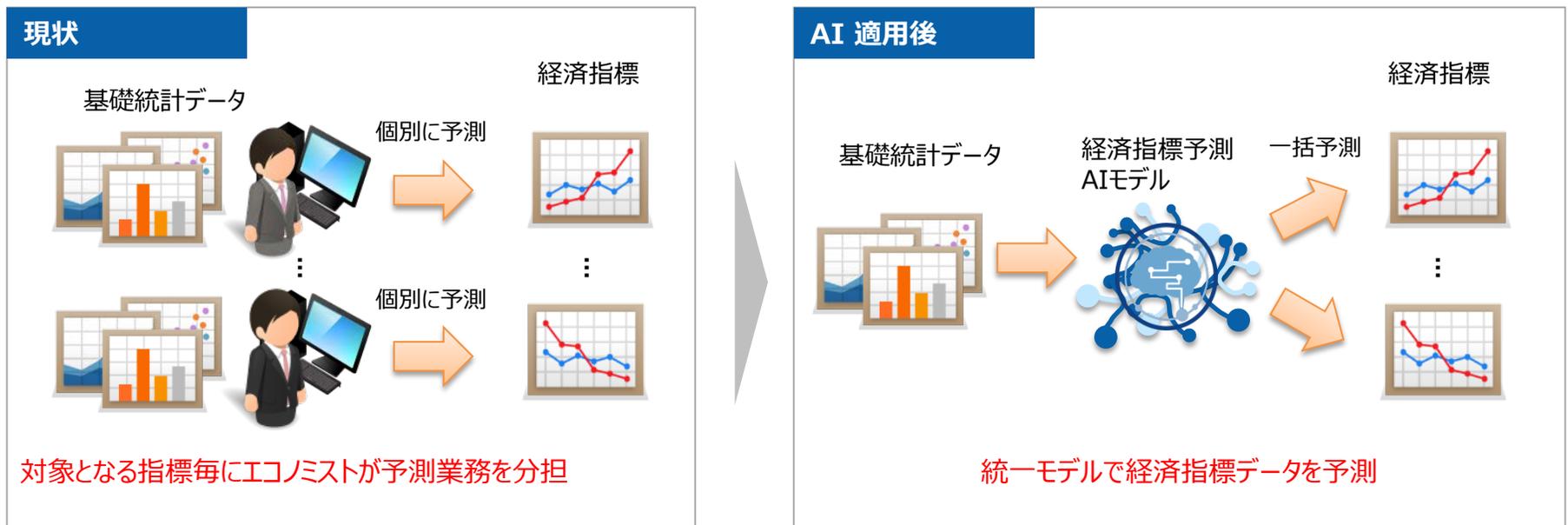
# 当資料に関して

- 当資料では、大和総研にて開発した人工知能（AI）を活用した経済指標予測モデルの概要を紹介いたします。
- 大和総研ではこれまで、毎月対象となる指標毎に複数のエコノミストが予測業務を分担しておりましたが、今後は、AIを活用した経済指標予測モデルに置き換えることで、**予測業務の効率化と客観的かつ統一的な分析の実現**を目指します。

# 経済指標予測モデルの概要

- AIを活用した経済指標予測モデルでは複数の指標を一括で予測することを実現しました。
- 経済指標予測モデルの活用により、「予測業務の効率化」と「客観的かつ統一的な分析」の実現を目指します。

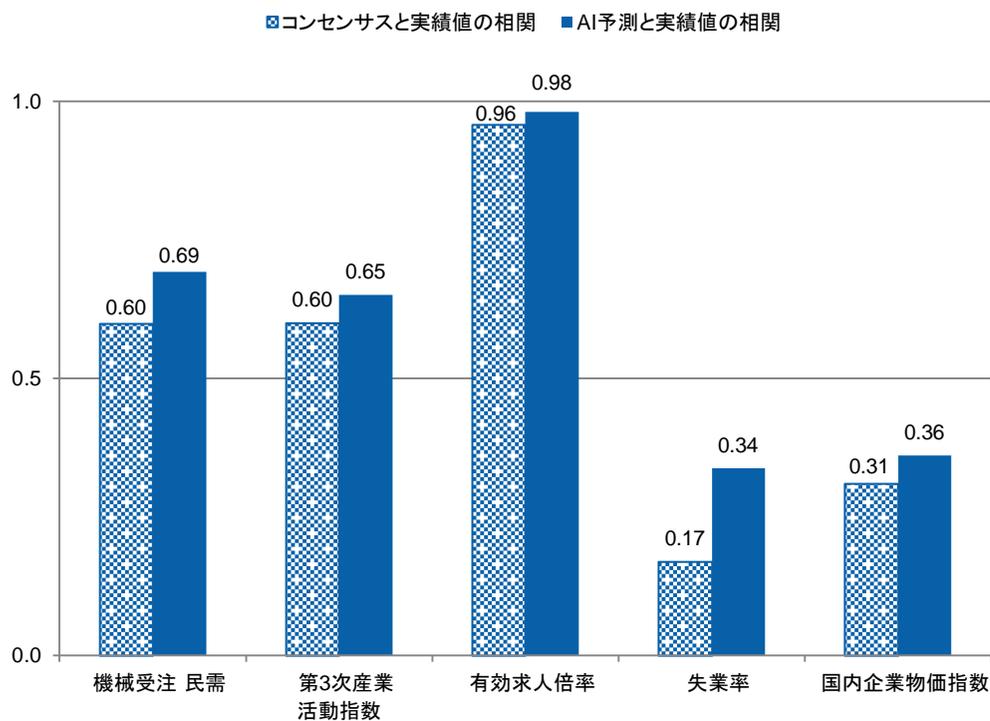
## 作成イメージ



# 予測対象指標一覧

- 以下 7 指標を AI を活用したモデルにて一括予測
- うち、テスト期間にて予測精度がコンセンサスを上回った 5 指標を公表予定

## 実績との相関係数比較



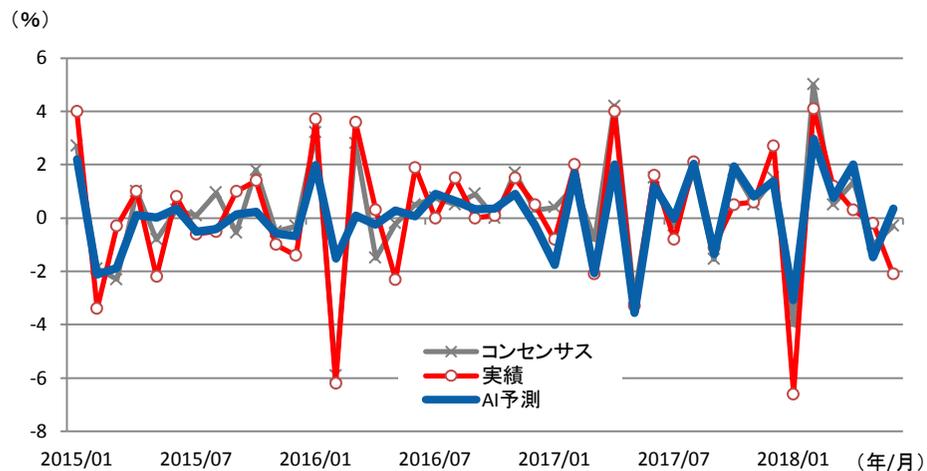
(出所) 内閣府、経済産業省、厚生労働省、総務省、日本銀行、Bloombergより大和総研作成

| 経済指標                          | 予測対象     |
|-------------------------------|----------|
| 機械受注 民需 (除く船舶・電力)             | 季節調整済前月比 |
| 第3次産業活動指数                     | 季節調整済前月比 |
| 有効求人倍率                        | 季節調整済倍率  |
| 失業率                           | 季節調整済水準  |
| 企業物価指数 (国内企業物価指数)             | 前月比      |
| 鉱工業指数 (生産)                    | 季節調整済前月比 |
| 消費者物価指数 (全国、生鮮食品除く総合) (コアCPI) | 前年比      |

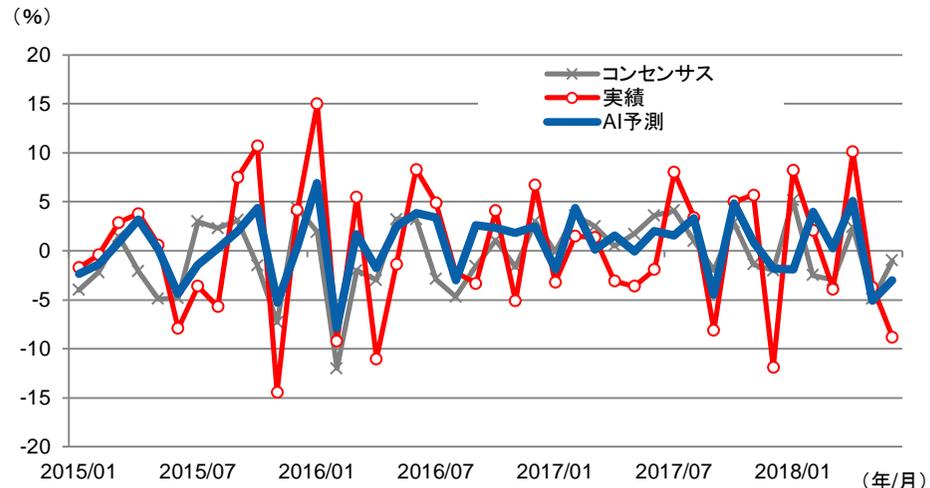
AIによる  
予測値を  
公表予定

# モデル予測結果 実績及びコンセンサスとの比較

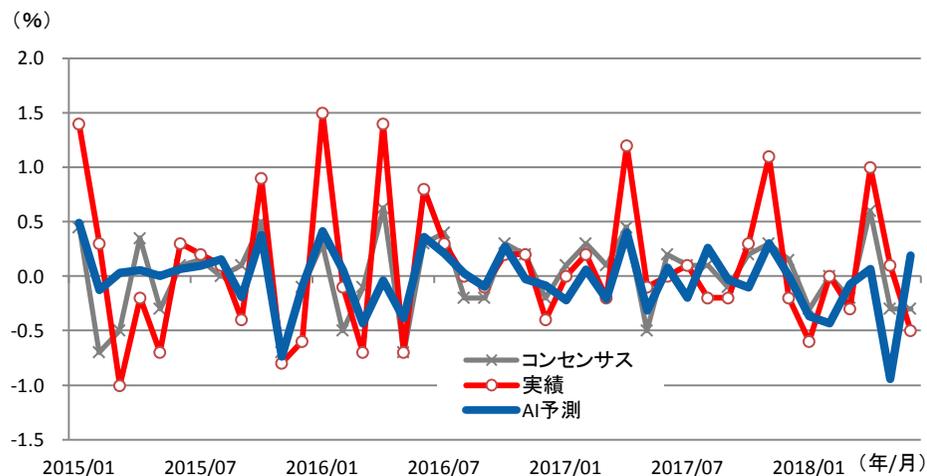
## 鉱工業指数（生産） 前月比



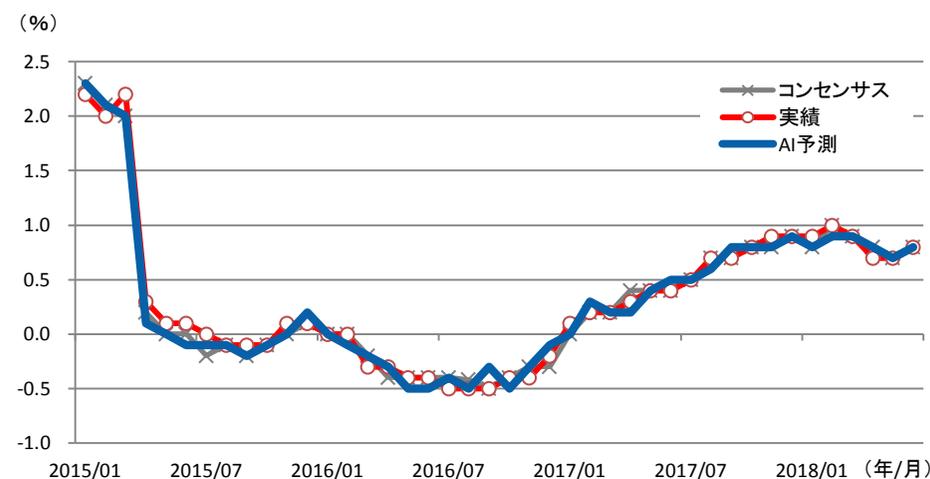
## 機械受注 民需(除く船舶・電力) 前月比



## 第3次産業活動指数 前月比



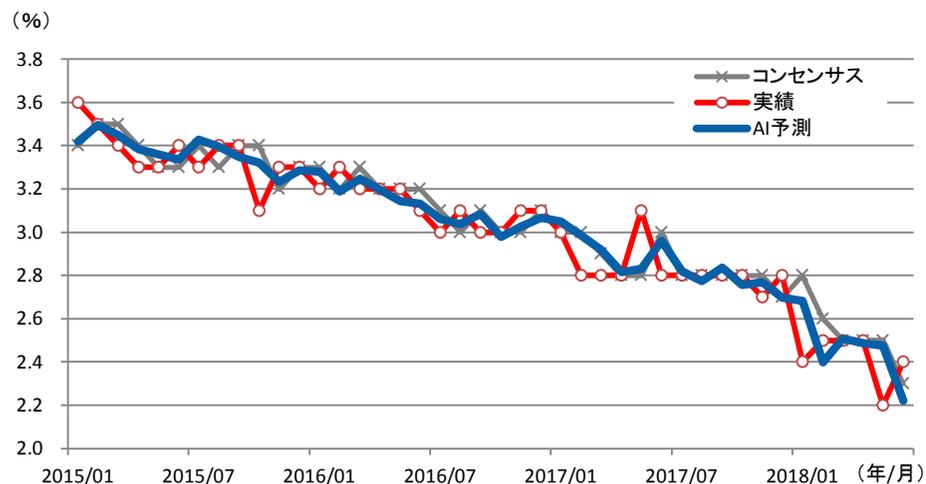
## コアCPI（全国・除く生鮮食品）前年比



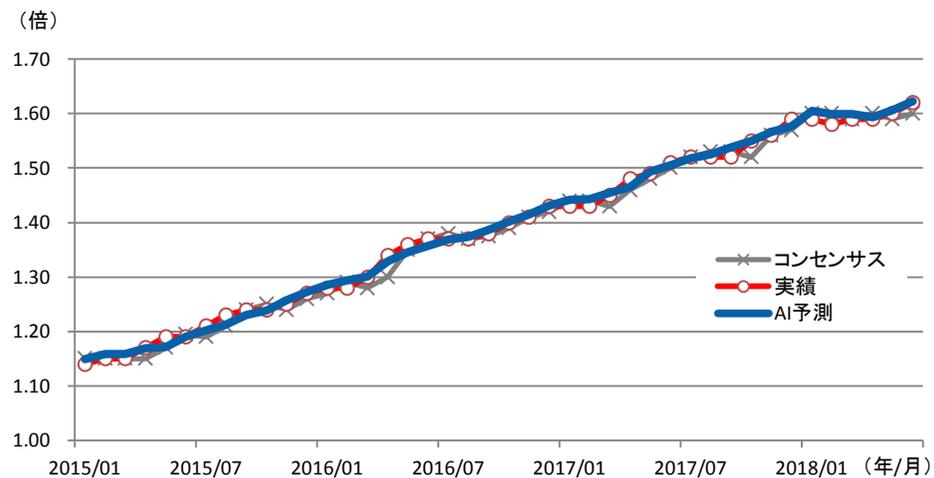
(出所) 経済産業省、内閣府、総務省、Bloombergより大和総研作成

# モデル予測結果 実績及びコンセンサスとの比較

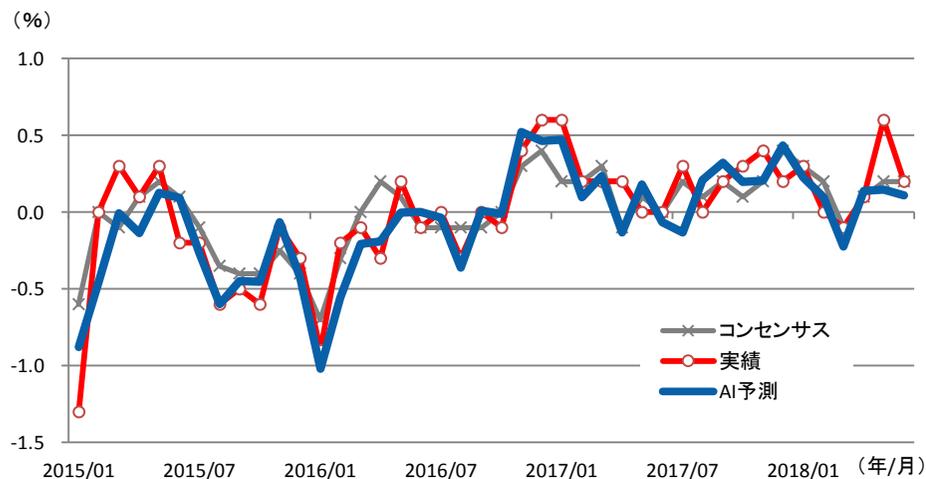
## 失業率



## 有効求人倍率



## 国内企業物価指数 前月比



(出所) 総務省、厚生労働省、日本銀行、Bloombergより大和総研作成

本資料は投資勧誘を意図して提供するものではありません。

本資料記載の情報は信頼できると考えられる情報源から作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、記載された意見や予測等は作成時点のものであり今後予告なく変更されることがあります。

(株)大和総研の親会社である(株)大和総研ホールディングスと大和証券(株)は、(株)大和証券グループ本社を親会社とする大和証券グループの会社です。

内容に関する一切の権利は(株)大和総研にあります。無断での複製・転載・転送等をご遠慮ください。