

コロナ禍の倒産件数予測モデルによる 2021 年 Q2・Q3 更新

滋賀大学と株式会社帝国データバンクとの共同研究センターである DEML センターは、コロナ禍倒産件数予測モデルによる、2021 年第 2 四半期・第 3 四半期の倒産件数予測を行いました。

本モデルは昨年 10 月に発表を行った倒産件数を被説明件数とする重回帰モデルをもとに、指標となるデータの本年度第 1 四半期更新を反映したモデルです。

倒産件数の変動の説明変数として、以前のモデルで高い予測力の得られた日銀短観の業況 DI、販売価格 DI-仕入価格 DI、貸出態度 DI、貸出約定平均金利、実質実効為替レートの 6 変数を選択しました。

今回モデルも外れ値の影響を軽減する頑健推定により、適切なパラメータを得られました。

これまでの実績倒産件数と本年第 2 四半期と第 3 四半期の倒産件数予測は下記の通りであり、実績倒産件数が引き続き低水準で推移し前期予測より更に減少した他、予測値の推移も第 1 四半期実績見込みよりも高水準であるものの減少傾向にあることが予測されています。

直近実績倒産件数と予測倒産件数

	'20-Q2 実績	'20-Q3 実績	'20-Q4 実績	'21-Q1 実績見込み	'21-Q2 予測	'21-Q3 予測
信頼区間上限	—	—	—	—	2799.838	2536.095
実績・予測	2,052	1,904	1762	1517	1987.792	1969.983
(補正前)	(1,852)	(2,104)	—	—	—	—
信頼区間下限	—	—	—	—	1175.747	1403.871

倒産件数予測結果_信頼区間95%

