

鉬工業出荷内訳表、鉬工業総供給表の季節調整方法について

平成 29 年 5 月 8 日

(1) 手法

鉬工業出荷内訳表、鉬工業総供給表における季節調整方法については、センサス局法の X-12-ARIMA により季節要因に加え、曜日・祝祭日要因、うるう年要因によっても調整を行っている。

具体的には以下のとおり。

$$\text{季節調整済指数} = \text{原指数} \div (\text{季節} \cdot \text{曜日} \cdot \text{祝祭日} \cdot \text{うるう年指数})$$

(2) スペックファイル

使用しているスペックファイルの見本は以下のとおり。なお、異常値処理については、鉬工業指数の出荷と同様に、tc 2011 年 3 月、tc 2011 年 4 月とした。

```
series { start = 2009.1
          span = (2009.1,2016.12)
          decimals = 1 }
transform { function = log }
arima { model = (0 1 2)(0 1 1) }
regression { variables = (td1nolpyear lpyear tc2011.3 tc2011.4)
              save = (td hol)
              user = (jap-hol)
              usertype = holiday
              start = 2009.1
              file = "xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx" }
forecast { maxlead = 12 }
estimate { save = ( mdl )
           maxiter = 500 }
x11 { print = (none + d10 +d11 +d16)
      save = (d10 d11 d16)
      seasonalma=x11default }
```

(3) 季節指数等の運用

平成 29 年 1 月以降の季節指数は、暫定季節調整方式を採用している。

具体的には、平成 28 年の季節要因と、上記(2)で推計されたパラメータとカレンダーから計算した曜日・祝祭日・うるう年要因から、季節指数を作成、利用している。