

鉱工業指数における季節調整方法の適用について

1. 手法

平成 17 年基準鉱工業指数における季節調整は、米国センサス局の X-12-ARIMA(version0.2.10)を用いて実施した。

季節調整済指数は、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されている(在庫・在庫率指数については、季節要因のみ)。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. X-12-ARIMA に用いるスペックファイル

平成 17 年基準改定時に使用したスペックファイルの見本は以下のとおり。

```
series { start = 2001.1
        span = (2001.1,2007.12)
        decimals = 1 }
transform { function = log }
arima { model = (2 1 0)(0 1 1) }
regression { variables = (td1nolpyear lpyear) → 在庫・在庫率指数の場合は、
        save = (td hol)                          regression の { }内を削除
        user = (jap-hol)
        usertype = holiday
        start = 2001.1
        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20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19年の季節指数を適用している。

これに対し、曜日・祝祭日・うるう年指数は、暫定方式を採らず、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て利用している。