

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

2020年5月12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。

```
series { start = 2012.1
         span = (2012.1,2019.12)
         decimals = 1 }
transform { function = log }
arima { model = (0 1 1)(0 1 1) }
regression { variables = (td1nolpyear)
            save = (td hol)
            user = (jap-hol)
            usertype = holiday
            start = 2012.1
            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

2020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、2019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・祝祭日要因から、季節指数を作成、利用している。