

## 季節調整スペック

- 季節調整は、X-12-ARIMA を使用し、品目毎に実施。
- 毎年4月頃、利用可能な全期間のデータを用いて、季節調整替えを実施。次回季節調整替えまでの間は、予定季節要素を用いて季節調整値を算出。
- ARIMA モデルのスペックは、原則、automdl コマンドで選択された次数を採用するが、2を超える次数が選択された場合には、(0 1 1)(0 1 1)を設定。
- regARIMA による事前調整パートでは、曜日・閏年・祝日等調整を実施しており、祝日等調整にはユーザー定義変数を用いている。このほか、outlier コマンドによって、デフォルト設定のもとで、異常値および一時的変化の有無を判定したうえで調整を行っている。これらは、すべてAICベースで採否を決定している。
- 上記のほか、乗法モデルを用い、対数変換を実施。また、ARIMA モデルによる先行き予測期間は60か月。なお、後戻り予測は行っていない。
- また、基礎統計（第3次産業活動指数など）で季節調整値を公表している系列については、当該スペックについても検証を行った。その他、regARIMA による事前調整パートにおいて追加的な対応を行っている品目の季節調整スペックは以下のとおり。

|       | ARIMA モデル      | 曜日調整・閏年調整           | 祝日調整 | 異常値   |
|-------|----------------|---------------------|------|---|
| 実質自動車 | (1 1 0)(2 1 0) | あり<br>(td)          | あり   | TC2009. Nov<br>A02010. Aug<br>TC2010. Oct<br>TC2011. Mar<br>TC2011. Apr<br>LS2012. Sep<br>LS2014. Apr<br>A02014. Dec<br>A02015. Apr<br>LS2019. Oct<br>TC2020. Apr<br>A02020. May<br>TC2021. Sep |
| 実質家電  | (0 1 1)(0 1 1) | あり<br>(td1nolpyear) | なし   | ls2011. Aug<br>ao2014. Mar<br>tc2014. Apr<br>ao2019. Sep<br>tc2019. Oct<br>ls2020. Jun<br>ls2020. Jul   |
| 名目旅行  | (0 1 1)(0 1 1) | あり<br>(td)          | あり   | ao2014. Mar<br>ao2014. Apr<br>ao2015. Sep   |