

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 (td)	あり	TC2009. Nov A02010. Aug TC2010. Oct TC2011. Mar TC2011. Apr LS2012. Sep LS2014. Apr A02014. Dec A02015. Apr LS2019. Oct TC2020. Apr A02020. May TC2021. Sep LS2022. Jan
実質家電	(0 1 1) (0 1 1)	あり (td1no1pyear)	なし	A02010. Nov TC2010. Dec LS2011. Aug A02014. Mar TC2014. Apr A02019. Sep TC2019. Sep TC2020. Jun
名目旅行	(1 1 0) (0 1 1)	あり (td)	あり	TC2003. Apr A02003. Jun TC2009. May A02009. Sep TC2011. Mar TC2019. Apr TC2020. Feb TC2020. Mar TC2020. Apr A02020. May TC2020. May A02020. Jun TC2020. Aug TC2020. Oct A02020. Dec TC2021. Jan TC2021. Feb A02021. Mar TC2021. Mar A02021. May TC2021. May A02021. Jul TC2021. Jul A02021. Nov A02021. Dec TC2021. Dec A02022. Feb A02022. Mar TC2022. Jun A02022. Aug A02022. Sep A02022. Nov A02023. Jan A02023. Mar TC2023. May A02023. Aug