

第7 季節調整

1 季節調整済指数の作成

季節調整済指数の作成には、家計調査などの諸統計で用いられている季節調整法との整合性を考慮し、アメリカ合衆国のセンサス局で開発されたセンサス局法（X-11）を用いる²⁵。適用に際しては、特異項認定のための管理限界は $2.0\sigma \sim 3.0\sigma$ とし、その他は標準オプションを用いる。

2 季節調整済指数の作成に用いる原系列

季節調整済指数の作成には、系列ごとに平成17年1月時点で接続した平成12年1月以降の指数を用いる。

$$\begin{array}{l} \text{平成17年基準 接続指数} \\ \text{（季節調整用原系列）} \end{array} = \text{平成12年基準指数} \times \frac{\text{平成17年基準の平成17年1月指数}}{\text{平成12年基準の平成17年1月指数}}$$

3 季節調整済指数の改定

毎月公表する時系列データの季節調整値は、前年12月までのデータを用いて求められる当年1月から12月までの季節要素（推定季節指数）で当年の各月の原系列を除して算出する。その後、当年12月までのデータがそろった時点で、当年のデータを含めて再び季節調整を行うことにより、改定された季節調整値を算出する。季節調整値は、毎年新しいデータが加わる度に、それを含めて計算することにより過去の値をすべて改定する。

4 季節調整済指数の作成系列

以下の8系列の指数について、全国及び東京都区部の季節調整済指数を作成する。

- ・ 総合
- ・ 生鮮食品を除く総合
- ・ 持家の帰属家賃を除く総合
- ・ 持家の帰属家賃及び生鮮食品を除く総合
- ・ 食料（酒類を除く）及びエネルギーを除く総合
- ・ 財
- ・ 半耐久消費財
- ・ 生鮮食品を除く財

²⁵ 家計調査ではX-12-ARIMAの採用で期待される効果が得られず、むしろ不安定になる可能性があることから、X-12-ARIMAの採用を見送っている。消費者物価指数では平成17年基準から、家計調査では18年2月から、X-12-ARIMAのX-11パートにより計算している。

[参考] 季節調整の方法

季節調整の方法には、総合、10大費目、中分類といった項目の指数を、分類項目ごとに季節調整する方法（単独方式）と、品目ごとに季節調整を行い、それらの季節調整済指数をそれぞれのウエイトで加重平均し、上位項目の季節調整済指数を求める方法（インプリシット方式）がある。

消費者物価指数においては、例えば毎年4月に変化する授業料のように階段状の動きを示すものなど、季節調整のモデルに当てはまらない品目がある。このことから、消費者物価指数の季節調整には、総合指数等に対する単独方式を採用している。