

## 第7 季節調整

### 1 季節調整済指数の作成方法

物価変動の基調をみるために、季節調整済指数を作成している。

季節調整の方法は、アメリカ合衆国のセンサス局で開発されたプログラムX-12-ARIMAを用いている。ARIMAモデルのスペックファイル(平成22年基準改定時)は、次のとおりである。

```
series{start=2005.01
span=(2005.1,2010.12)
period=12
decimals=0}
transform{function=log}
regression{ }
x11{sigmalim=(2 3)
seasonalma=X11default
appendfcst=yes
save=(d10 d11)}
arima{ model=(0 1 1)(0 1 1)}
estimate{ }
```

### 2 季節調整済指数の作成に用いるデータ

季節調整済指数の作成には、系列ごとに平成22年平均指数で接続した平成17年1月以降の指数を用いる。

$$\text{平成22年基準接続指数 (季節調整用原系列)} = \text{平成17年基準指数} \times \frac{\text{平成22年基準の平成22年平均指数(100)}}{\text{平成17年基準の平成22年平均指数}}$$

### 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、始期である平成17年1月から前年12月までのデータから求められる当年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いて算出する。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

次の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。

< 基本分類指数 >

- ・ 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・サービス分類指数 >

- ・ 財
- ・ 半耐久消費財
- ・ 生鮮食品を除く財

[ 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、総合指数などに対する単独方式を採用している。