

家計調査の結果を見る際のポイント No.11

月末の曜日などの変動の要因を含めた季節調整値

1. 家計調査の季節調整値

家計調査(二人以上の世帯)で公表している1世帯当たり平均の消費支出額は、12か月を周期とする季節的な変動の影響を受けています。家計調査ではこの影響を取り除くため、移動平均を用いた季節調整法^{注1)}により消費支出額の調整を行い、主要項目の季節調整値として、基準年を100とした指数及び対前月変化率を毎月公表しています。しかし、「家計調査の結果を見る際のポイント No.1」で示した月末の曜日など12か月を周期としない変動の影響については調整を行っていません。

2. 季節調整法による月末の曜日などの変動の影響

そこで、別の季節調整法^{注2)}を用いて変動の要因にうるう年(4年周期)、月末の曜日(28年周期)、曜日(7日周期)を含めて、実質消費支出(除く住居等)^{注3)}の季節調整を行い、月末の曜日などの変動の影響を試算しました。

その結果、実質消費支出(除く住居等)についてみると、うるう年の2月はそうでない2月に比べ2.1ポイント程度高く、月末の曜日の関係で支出が翌月の口座引き落としになる月はそうでない月に比べ0.8ポイント程度低く、曜日の関係で土・日曜日が1日増える(月～金曜日が1日減る)月はそうでない月に比べ0.5ポイント程度高くなることが分かりました。

3. 公表値と試算値の比較

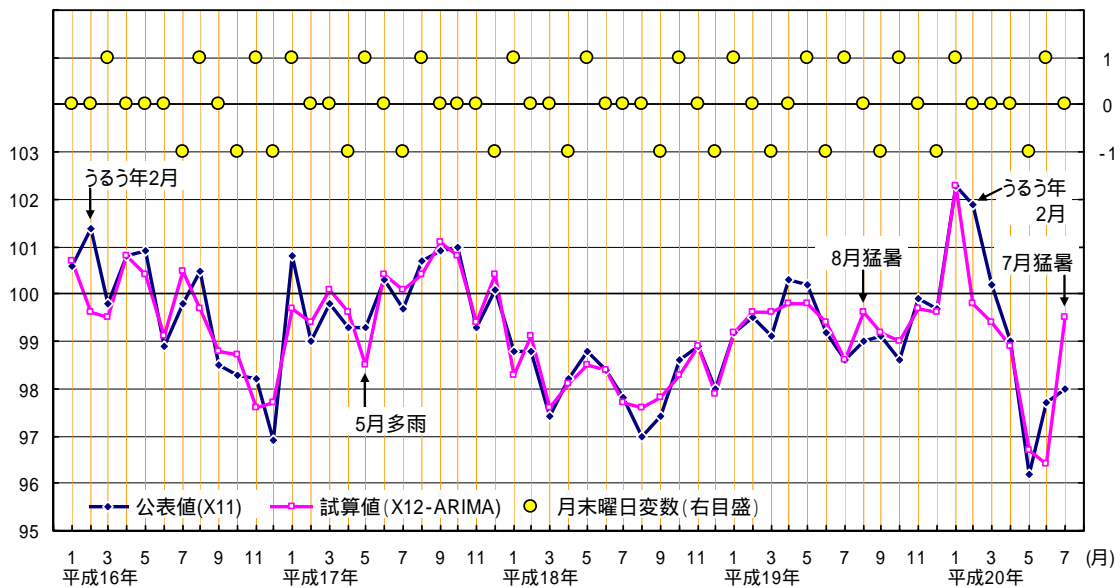
公表値と試算値を次のとおり比較してみると、平成20年7月は、前年の月末の曜日の影響などにより、公表値の方が1.5ポイント低くなりました。また、平成20年5月、6月は同年の月末の曜日の関係などにより、5月は公表値の方が0.5ポイント低く、6月は公表値の方が1.3ポイント高くなっています。うるう年で日数が1日多かった、平成20年2月は公表値の方が2.1ポイント高くなっています(表、図)。

表 消費支出(除く住居等)(季節調整済実質指数)

	平成19年					平成20年						
	8月	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月
公表値	99.0	99.1	98.6	99.9	99.7	102.3	101.9	100.2	99.0	96.2	97.7	98.0
試算値	99.6	99.2	99.0	99.7	99.6	102.3	99.8	99.4	98.9	96.7	96.4	99.5

図 消費支出（除く住居等）（季節調整済実質指数）及び月末曜日変数

平成17年 = 100



(参考1)試算に用いたスペックファイル

```
series{
  file="住宅等を除く消費支出"
  start=2000.1
  span=(2000.01,2007.12)
  period=12
}
transform{ function=log } #原数値を対数に変換
regression{
  variables = (td1nolpyear lpyear) #曜日日数(月~金と土・日曜日の2分割)とうるう年を
  #回帰変数として指定
  user =(m-end) #月末の曜日を回帰変数として指定
  usertype= (holiday)
  start=1997.1
  file = "月末の曜日変数"
}
automdl { } #ARIMAモデルの自動選択((1 0 0)(1 1 0)を選択)
estimate{
  save = mdl
}
forecast{
  maxLead=60
}
outlier { } #はずれ値の自動検出(平成12年12月がはずれ値として検出)
x11{
  sigmaLim=(2 3)
  seasonalMa=x11default
  appendFcst=yes
  save=(d10 d11 d16)
}
}
```

(参考2)試算したうるう年、月末の曜日、曜日(月～金)回帰変数の係数とt値

	係数	t値
うるう年	0.0209	3.01
月末の曜日	0.0076	5.46
曜日(月～金)	-0.0013	-3.86

注)各回帰変数の値

うるう年: 0.75 うるう年の2月

-0.25 うるう年以外の2月

0 その他の月

月末の曜日: -1 月末に金融機関が休み(土・日曜日、その他の休日)で翌月口座引落としとなる月

1 前月の月末に金融機関が休みで今月の口座引落としとなる月

0 月末の曜日の影響がない、あるいは前月今月ともに口座引落としが翌月となる月

曜日(月～金): 月～金曜日の日数 - 5/2 × 土・日曜日の日数

(参考3)予測(延長)季節指数

	平成20年											
	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
X11	97.4	93.1	103.0	104.1	99.4	95.5	99.8	100.5	94.3	99.7	96.3	117.0
X12-ARIMA	97.3	95.0	103.8	104.2	98.8	96.8	98.3	100.0	94.6	98.4	96.8	116.9

(平成20年8月29日 作成)

注1) 季節調整の方法は、センサス局法(X12-ARIMA の X11 デフォルト、管理限界 2 ～ 3)を用いています。季節指数(季節調整値 = 原数値 / 季節指数)の推定に使用したデータの期間は平成 12 年 1 月～19 年 12 月で、20 年 1 月以降は、予測(延長)季節指数を使用しています。

なお、X11 の予測(延長)季節指数は、最後の年の季節指数 + (最後の年の季節指数 - その前年の季節指数) / 2 で算出されています。

注2) 季節調整の方法は、センサス局法(X12-ARIMA Ver.0.3、詳細は(参考1)試算に用いたスペックファイルを参照してください)を用いています。推定の期間は平成 12 年 1 月～19 年 12 月で、20 年 1 月以降は、予測(延長)季節指数を使用しています。

注3) 消費支出(除く住居等)については、「家計調査の結果を見る際のポイントNo. 4」を参照願います。