

中部地域鉱工業指数における季節調整方法の適用について

1. 手法

2020 年基準中部地域鉱工業指数における季節調整は、米国センサス局の X-12-ARIMA (version0.3) を用いて実施した。

季節調整済指数系列は、季節要因に加え、曜日・祝祭日要因、うるう年要因によっても調整されている（在庫・在庫率指数については、季節要因のみ）。具体的には、以下のとおり。

$$\text{季節調整済指数} = \text{原指数} \div (\text{季節} \cdot \text{曜日} \cdot \text{祝祭日} \cdot \text{うるう年指数})$$

2. X-12-ARIMA に用いるスペックファイル

2020 年基準改定時に使用したスペックファイルの見本は、以下のとおり。

```
series      { start = YYYY.M
              span = (2015.1, 2022.12)
              decimals = 1 }
transform   { function = log }
arima        { model = (1 1 0) (0 1 1) }
regression  { variables = (tdlnolpyear lpyear) → 在庫・在庫率指数の
              save = (td hol)                  場合は、regression
              user = (jap-hol)                  の { } 内を削除
              usertype = holiday
              start = YYYY.M
              file = "xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx " }
forecast     { maxlead = 12 }
estimate     { save = ( mdl ) maxiter = 500 }
x11          { print = (none +d10 +d11 +d16)
              save = (d10 d11 d16)
              seasonalma=x11default }
```

3. 季節指数等の適用

2023 年 1 月以降の季節指数は、暫定季節調整方式により、2022 年の季節指数と 2023 年の曜日・祝祭日指数から計算している。

これについては、毎年１回、年間補正時に当該年のデータを確定させたあと、改めて計算した季節指数により正式な季節調整済指数の算出を行う。

4. 異常値処理

2020 年基準改定において、異常値が検出された系列と異常値処理を行った種別及び年月は、以下のとおり。

	異常値種別	処理年月
生産指数	T C	2020 年 4 月
	T C	2020 年 5 月
	L S	2020 年 7 月
	T C	2021 年 8 月
	T C	2021 年 9 月
	T C	2021 年 11 月
	A O	2022 年 1 月
	T C	2022 年 5 月
出荷指数	T C	2020 年 4 月
	T C	2020 年 5 月
	L S	2020 年 7 月
	T C	2021 年 8 月
	T C	2021 年 9 月
	T C	2021 年 11 月
	A O	2022 年 1 月
	T C	2022 年 5 月
在庫指数	-	-
在庫率指数	-	-
東海指数	T C	2020 年 4 月
	T C	2020 年 5 月
	L S	2020 年 7 月
	T C	2021 年 8 月
	T C	2021 年 9 月
	T C	2021 年 11 月
	A O	2022 年 1 月
	T C	2022 年 5 月