

季節調整法の適用状況に関する整理表

府省等名	調査名	系列	季節調整法	当該方法の選定理由	データ期間	オプション選択基準	オプション等 の見直しの頻 度	データ追加に伴う季節調 整値の改訂頻度	異常値やレベルシフト の取扱い	世界金融 危機への 特別な対 応	祝日の設定	その他の調整	備考
内閣府	機械受注統計調査	需要者別受注額、機種別受注残高手持月数	X-12-ARIMA の中のX11	X-12-ARIMAを用いることを検討したが、その方法では季節調整値の安定性の点で改善がみられなかった。ただし、X-12-ARIMAの中のX-11パートが改善されていることを考慮し、そのX-11パートを平成17年4月調査より用いることとした	1987年4月以降		なし	年1回（3月調査）	設定なし	特になし	設定なし	特になし	
総務省	労働力調査	完全失業率等	X-12ARIMA のX-11デ フォルト	完全失業者数などについての過去の検討では、X-11と比べARIMAモデルを用いた方が安定性などで決定的に優れているとは断定できず、休日数の調整なども基本的には不要のため、実務面も考慮しX-11のままとしている。	29年	デフォルト	見直しせず	毎年	特異項の管理限界を9.8σ～9.9σに設定	なし	なし	なし	特異項の管理限界については現在検討中
	家計調査	二人以上の世帯の主要項目（月次）	X-12-ARIMA (Ver. 0.3)	従来の季節調整調整法(X-11)からの延長	平成12年1月～20年12月までの9年（今後最新データが更新される度に12年まで延長の予定）		5年に1度（外れ値については毎年）	毎年	・X-12-ARIMAの自動検出機能(outlier)によりLS（レベルシフト）、AO（加法的外れ値）を回帰変数に追加 ・類似系列（名目・実質等）の比較から自動検出されない外れ値を追加 ・特異項の管理限界を1.5σ～3.0σに設定	なし	「国民の祝日に関する法律で定める祝日・国民の休日を考慮	うるう年、曜日、月末の曜日（金融機関が月末に休みとなること）によって引き落としが翌月となること）を系列により調整	将来的には必要に応じて外れ値にramp（傾斜的水準変化）の使用を検討
		総世帯、二人以上の世帯、単身世帯の主要項目（四半期）	X-12ARIMA のX-11デ フォルト	従来の季節調整調整法(X-11)からの延長	全期間（最新のデータが追加される度に延長）	デフォルト	見直しせず	毎年	特異項の管理限界を2σ～3σに設定	なし	なし	なし	
		消費水準指数（月次・四半期等）	X-12ARIMA のX-11デ フォルト	従来の季節調整調整法(X-11)からの延長	全期間（最新のデータが追加される度に延長）	デフォルト	見直しせず	毎年	特異項の管理限界を2σ～3σに設定	なし	なし	なし	なし
	消費者物価指数（CPI）	①総合 ②生鮮食品を除く総合 ③持家の帰属家賃を除く総合 ④持家の帰属家賃及び生鮮食品を除く総合 ⑤食料（酒類を除く）及びエネルギーを除く総合 ⑥財 ⑦半耐久消費財 ⑧生鮮食品を除く財	X-12ARIMA のX-11デ フォルト	消費者物価指数については、欧米諸国と同様、季節調整値ではなく、原系列の前年同月比を主として用いている。また、月の日数の影響をほとんど受けないこと、別途品質調整による補正を行っていることなどから、ARIMAモデルを採用する理由も乏しく、X-12-ARIMAのX-11デフォルトのままとしている。	前基準年から前年まで（2009年については、2000年～2008年データ）	デフォルト	見直しせず	毎年	特異項の管理限界を2σ～3σに設定	なし	なし	なし	

府省等名	調査名	系列	季節調整法	当該方法の選定理由	データ期間	オプション選択基準	オプション等の見直しの頻度	データ追加に伴う季節調整値の改訂頻度	異常値やレベルシフトの取扱い	世界金融危機への特別な対応	祝日の設定	その他の調整	備考
財務省	貿易統計	輸出総額、輸入総額	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.10)	季節調整の適切性及び、安定性の比較結果等より選定	最新120ヵ月分	RegARIMAモデルの選択:AIC最小化基準等により選択 輸出(212)(011) 輸入(110)(011)	年1回	毎月	設定なし	検討中 (外部の専門家に検討を依頼)	「国民の祝日に関する法律」で定める祝日のみを考慮。		
	国際収支統計	輸出、輸入、輸送(受)、輸送(払)、旅行(受)、旅行(払)、その他サービス(受)、その他サービス(払)、雇業者報酬(受)、雇業者報酬(払)、直接投資収益(受)、直接投資収益(払)、証券投資収益(受)、証券投資収益(払)、その他投資収益(受)、その他投資収益(払)、経常移転(受)、経常移転(払)	X-12-ARIMA	季節調整の適切性及び安定性の比較結果等から選定	H8.1～H20.12	ARIMAモデル選択:原系列の自己相関度合い・各モデルのAIC値等 曜日調整及び予測機能使用:季節調整の適切性及び安定性分析	年2回	年2回(前年12月分までのデータ(前年10～12月分は速報ベースのデータ)を用いて季節調整をかけた後、全データの適及計算を行う(3月頃)。さらに、前年12月分までの確認ベースのデータが揃った後、再度季節調整をかけた後、全データの適及計算を行う。(5月頃)。) なお、それまでの各月次データ<1～12月分>については、季節要素の予測値<前年12月分までのデータから算出>を用いて季節調整値を計算し、公表する。	異常値と一時変化の検出・判定基準はX-12-ARIMAの自動調整機能(デフォルト設定)による。レベルシフトやランプ変数は事象に応じて別途設定する。(例:旅行収支における計上方法改訂)。	12月分までのデータが揃った段階で検討予定。	「国民の祝日に関する法律」で定める祝日に加えて、社会通念上の休暇も考慮する(法律の定めに関わらず、当該変数が有意か否かによって判断する考え)。 なお、貿易収支については、通関日数をベースにしたユーザー定義変数を使用。		
厚生労働省	毎月勤労統計調査	雇用指数、賃金指数、労働時間指数及び入・離職率(月次及び四半期)	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.9) (X-11デフォルト)	過去との継続性を重視しX-11デフォルトを用いているところである。	原則として、指数作成開始時点から平成20年12月までであるが、指数作成開始時点が昭和27年1月である系列については、昭和30年1月から平成20年12月までである(ただし、毎年12月までのデータが揃った段階でデータ追加)。	継続性を重視し、旧X-11の標準型を使用している。また、季節調整のタイプは乗法型としている。	平成12年1月分調査から、それまで用いていたX-11に替えてX-12-ARIMAを用いることとした。その後特段の見直しは行っていない。	年1回(毎年12月までのデータが揃った時点で、季節調整指数(入・離職率については季節調整率の入・離職率)と季節要素を算出している(季調整)。それ以降のデータについては、前述の季節要素を暫定季節要素として用いて算出している。また、季調整に伴うデータ改定は、始期に溯り行っている。)	設定なし	特に予定していない。	設定なし	特になし	
	労働経済動向調査	生産・売上、所定外労働時間、正社員等、臨時労働者、パートタイム労働者、派遣労働者のそれぞれについて、増加事業所割合、減少事業所割合、判断D.I.の実績、実績見込み及び見込み(四半期)	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.9) (X-11デフォルト)	過去との継続性を重視しX-11デフォルトを用いているところである。	原則として、平成11年2月調査から平成20年11月調査までである。(ただし、毎年11月調査のデータが揃った段階でデータ追加)。	継続性を重視し、旧X-11の標準型を使用している。また、季節調整のタイプは加法型としている。	平成12年5月分調査から、それまで用いていたX-11に替えてX-12-ARIMAを用いることとした。その後特段の見直しは行っていない。	年1回、第4四半期分の集計終了後、過去全期間のデータを季節調整するとともに、向こう1年分の予測季節要素を算出し、翌年の第1四半期から第4四半期までの4四半期分は、この予測季節要素をもって季節調整を行う。	設定なし	特に予定していない。	設定なし	特になし	
	職業安定業務統計	新規求人、新規求職、有効求人、有効求職、就職件数	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.10)	季節調整の適切性及び、安定性の比較結果等より選定	全期間(1963年～)なお、モデルの回帰期間は直近10年	RegARIMAモデルの選択: 新規求人(0,1,6)(0,1,1)、 新規求職(2,1,0)(0,1,1)、 有効求人(5,1,0)(0,1,1)、 有効求職(2,1,0)(0,1,1)、 就職件数(0,1,2)(0,1,1)	定期的な見直しは行っていない。	年1回	レベルシフト:1975年4月(雇用保険法が施行された月)	特に予定していない。	「国民の祝日に関する法律」で定める休日(祝日、振替休日、国民の休日)、特別の法律で定められた休日、年末年始 なお、各月の曜日別日数を説明変数に用いている。	年間調整	

府省等名	調査名	系列	季節調整法	当該方法の選定理由	データ期間	オプション選択基準	オプション等 の見直しの頻 度	データ追加に伴う季節調 整値の改訂頻度	異常値やレベルシフト の取扱い	世界金融 危機への 特別な対 応	祝日の設定	その他の調整	備考
経済産業省	鉱工業指数	生産・出荷・稼働率・ 生産予測指数	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.10)	他の政府統計等他統計との 整合性確保、曜日祝祭日調 整の必要性の高まり	最新84時点	RegARIMAモデルの選 択:AIC最小化基準等 により選択 ARIMAモデル: (210)(011)	5年毎 基準改定時	年1回 年間補正作業時	設定なし	特になし	「国民の祝日」で 定める祝日のみ を考慮。	曜日調整につい ては、2曜日調 整を適用。 うるう年調整に ついては、対数 変換後回帰係数 調整を適用。	
	鉱工業指数	在庫・在庫率指数	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.10)	他の政府統計等他統計との 整合性確保、曜日祝祭日調 整の必要性の高まり	最新84時点	RegARIMAモデルの選 択:AIC最小化基準等 により選択 ARIMAモデル: (210)(011)	5年毎 基準改定時	年1回 年間補正作業時	設定なし	特になし	なし	曜日調整・うる う年調整なし。	
	第3次産業 活動指数	第3次産業活動指数	X-12-ARIMA (Release Version 0.2.10)	別紙参照	最新96時点	別紙参照	5年毎 基準改定時	年1回 年間補正作業時	設定なし	特になし	「国民の祝日」に 関する法律」で 定める祝日のみ を考慮。	曜日調整につい ては、系列によ り曜日調整なし、2曜日調整 を適用している。 うるう年調整に ついては、対数 変換後回帰係数 調整を適用。	
国土交通省	建築着工統 計	建築物着工、住宅着工	X-12-ARIMA	季節調整の適切性及び、安 定性を重視	昭和40年1月～	RegARIMAモデルの選 択:AIC最小化基準等 により選択、予測期間 なし	年1回	年1回（毎年12月ま でのデータがそろった段階 でデータを追加して季調 替え、それまでは前年・ 前々年のデータを使用し て暫定季節指数を作成 し、暫定値を作成してい る。）	X-12-ARIMAの自動調整 機能(outlier)を使用	なし	なし	なし	
	建設工事受 注動態統計 調査（大手 50社）		X-11	過去からの継続性を重視	昭和59年4月～	標準使用		年1回（毎年12月ま でのデータがそろった段階 でデータを追加して季調 替え、それまでは前年・ 前々年のデータを使用し て暫定季節指数を作成 し、暫定値を作成してい る。）		なし	なし	なし	
	輸送指数		X-12ARIMA (X-11デ フォルト)	過去からの継続性を重視	昭和45年1月～	標準使用	—	年2回	設定なし	なし	「国民の祝日」に 関する法律」で 定める祝日に加 え、社会通念上 の休暇（お盆、 年末年始）を考 慮している。	なし	—

府省等名	調査名	系列	季節調整法	当該方法の選定理由	データ期間	オプション選択基準	オプション等 の見直しの頻 度	データ追加に伴う季節調 整値の改訂頻度	異常値やレベルシフト の取扱い	世界金融 危機への 特別な対 応	祝日の設定	その他の調整	備考
日本銀行	銀行券発行 高	銀行券発行高平残、 銀行券発行高末残	X-12-ARIMA	安定性（MPD値およびMAPR 値）およびパワースペクト ル分析の比較結果等を考慮	S30. 1～H20. 12	原系列のACFやPACF、 モデルのAIC値、推定 パラメータの有意性、 Ljung - BoxのQ統計量 等をもとに総合的に判 断	年 1 回	年 1 回（毎年12月分ま でのデータが揃った段階で 季節調整をかけ直し、全 データについて遡及計算 を行う。なお、それま での各月分<1～12月分> については、季節要素の 予測値<前年12月分ま でのデータから算出>を用 いて季節調整済値を計算 し、公表する）。	異常値と一時変化の検 出・判定基準はX-12- ARIMAの自動調整機能 （デフォルト設定）に よる。レベルシフトや ランプ変数は事象に応 じて別途設定する （例：週休二日制の導 入、ペイオフ解禁）。	12月分ま でのデー タが揃っ た段階で 検討予 定。	「国民の祝日に 関する法律」で 定める祝日に加 えて、社会通念 上の休暇も考慮 する（法律の定 めに関わらず、 当該変数が有意 か否かによって 判断する考 え）。現状で は、末残につい てユーザー定義 変数を用いて調 整。		
	マネース トック関連 統計	M2平残		X-12-ARIMA	安定性（MPD値およびMAPR 値）およびパワースペクト ル分析の比較結果等を考慮	S42. 1～H20. 12	原系列のACFやPACF、 モデルのAIC値、推定 パラメータの有意性、 Ljung - BoxのQ統計量 等をもとに総合的に判 断	年 1 回	年 1 回（毎年12月確報分 までのデータが揃った段 階で季節調整をかけ直 し、全データについて遡 及計算を行う。なお、そ れまでの各月分<1～12 月分>については、季節 要素の予測値<前年12月 分までのデータから算出 >を用いて季節調整済値 を計算し、公表する）。	異常値と一時変化の検 出・判定基準はX-12- ARIMAの自動調整機能 （デフォルト設定）に よる。レベルシフトや ランプ変数は事象に応 じて別途設定する （例：ペイオフ解 禁）。	12月分ま でのデー タが揃っ た段階で 検討予 定。	「国民の祝日に 関する法律」で 定める祝日に加 えて、社会通念 上の休暇も考慮 する（法律の定 めに関わらず、 当該変数が有意 か否かによって 判断する考 え）。現状で は、末残につい て月末の曜日要 因を調整。	H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計のM2+CDを接続
		M3平残、M3末残	H8. 1～H20. 12			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計のM3+CD-金銭 信託を接続							
		M1平残、M1末残	S38. 1～H20. 12（末 残はS30. 1～ H20. 12）			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計のM1を接続							
		現金通貨平残	S38. 1～H20. 12			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計の現金通貨を 接続							
		預金通貨平残	S38. 1～H20. 12			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計の預金通貨を 接続							
		準通貨平残	S42. 1～H20. 12			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計の準通貨を接 続							
		広義流動性平残	S55. 1～H20. 12			H15. 3以前はマ ネーサプライ統 計の広義流動性 を接続							
	マネーベース平残準備率調 整後、マネーベース平残準 備率調整前		X-12-ARIMA	安定性（MPD値およびMAPR 値）およびパワースペクト ル分析の比較結果等を考慮	S45. 1～H20. 12	原系列のACFやPACF、 モデルのAIC値、推定 パラメータの有意性、 Ljung - BoxのQ統計量 等をもとに総合的に判 断	年 1 回	年 1 回（毎年、12月分ま でのデータが揃った段階 で季節調整をかけ直し、 全データについて遡及計 算を行う。なお、それま での各月分<1～12月分 >については、季節要素 の予測値<前年12月分 までのデータから算出>を 用いて季節調整済値を計 算し、公表する）。	異常値と一時変化の検 出・判定基準はX-12- ARIMAの自動調整機能 （デフォルト設定）に よる。レベルシフトは 事象に応じて別途設定 する（例：準備率変 更、金融市場調節方針 変更）。	12月分ま でのデー タが揃っ た段階で 検討予 定。	「国民の祝日に 関する法律」で 定める祝日に加 えて、社会通念 上の休暇も考慮 する（法律の定 めに関わらず、 当該変数が有意 か否かによって 判断する考 え）。		
	実質輸出入	実質輸出、実質輸入、 実質貿易収支		X-12-ARIMA	X-12-ARIMAで用いられる事 前調整型の曜日・祝祭日調 整の実施を考慮	S50. 1～H20. 2	原系列のACFやPACF、 モデルのAIC値、推定 パラメータの有意性、 Ljung - BoxのQ統計量 等をもとに総合的に判 断	年 1 回	年 1 回（毎年、前暦年の 確報値<年間補正後>が 揃った段階で、直近2月 までのデータを用いて季 節調整をかけ直し、全 データについて遡及改訂 を行う。なお、先行き1 年分<3月～翌年2月分> については、季節要素の 予測値を用いて季節調整 済値を計算）。	異常値と一時変化の検 出・判定基準はX-12- ARIMAの自動調整機能 （デフォルト設定）に よる。	2月分ま でのデー タが揃っ た段階で 検討予 定。	「国民の祝日に 関する法律」で 定める祝日に加 えて、税関休日 のほか社会通 念上の休暇も考 慮する（法律の 定めに関わら ず、当該変数が 有意か否かによ って判断する 考え）。	