

季節調整法検討小委員会報告書（抄）

平成9年6月

経済指標部会
季節調整法検討小委員会

IV 季節調整法の適用について（指針）

一般に、季節調整法について理論的に評価することは難しいが、季節調整法検討小委員会において4種類の季節調整法(X-11, MITI法, X-12-ARIMA, DECOMP)について検討を行ったところ、統計作成機関が今後季節調整法を運用していく上で参考になると思われる結果が得られた。また、統計利用者側の利用環境が変化し、様々な分析が可能な状況となっており、それに伴い統計情報に対する需要も増大している。これらの点にかんがみ、各種統計・指数系列に係る季節調整法の適用については、次のとおり推進するものとする。

- 1 季節調整法を適用する場合は、センサス局法X-12-ARIMAなど、手法の適切性について一般的な評価を受けている手法を継続的に使用する。統計作成機関は、適用する手法を選定した理由を明らかにする。
- 2 季節調整法を適用する際の推計に使用するデータ期間、オプション等の選定に当たっては、それぞれの系列に対して統計作成機関において適切と考えられ、客観性が保たれる基準を採用し、継続的に使用する。
- 3 データの追加又は期間の追加に伴って、オプション等の変更又は過去の季節調整値の変更を実施する頻度については、あらかじめ統計作成機関において基準を定め、利用者の利便性を考慮し、継続的にその基準を使用する。
- 4 適用している季節調整法については、その名称、推計に使用しているデータの期間、オプション等の選択基準、選定したオプション等の季節調整に関する情報を報告書等に掲載する。
また、適用している季節調整法、オプション等の選択の基準等の変更を行う場合は、変更の趣旨及び変更後の手法、基準等についても、報告書等に掲載する。
- 5 統計作成機関は、季節調整法に関する情報について、別途定める様式に従い、統計基準部に提出することとする。

統計基準部は、統計作成機関から提出された各々の情報について、一覧性のある資料に取りまとめて、一般に開示する。

V 「季節調整法の適用について（指針）」の運用要領

「季節調整法の適用について（指針）」に関する運用要領を以下のとおり定める。

（指針1について）

- 1 「一般的な評価を受けている手法」とは、手法が一般的に周知されており、理論的にも、実務上でも、明らかな誤りがあるとはいえないものである。例えば、X-12-ARIMA、X-11、MITI法、DECOMPなどの手法である。

統計作成機関は、所管している統計・指数系列の特徴に合わせ、手法の妥当性について速やかに検討した上で、実務上でも合理的な手法を適用することとする。

（指針2について）

- 2 季節調整法を使用する際のオプション等については、AIC値やBIC値などの統計量やMPD値、MAPR値などの安定性の尺度、スペクトル分析の結果による適切性の尺度など客観的な判断が可能な基準に基づいて選定することとする。

（指針3について）

- 3 季節調整値の公表、オプション等の見直し等については、以下に例示する方法など、各統計・指数系列の性格、実務上での状況、統計利用者の利便性を考慮して、適切であると判断した方法で行うこととする。

（例1） 前年12月までのデータを使用して、暫定季節指数を作成し、それを使用して暫定的な数値を公表する。当該年の12月までのデータがそろった段階で、オプション等の設定の見直し、季節調整のかけ直し、確定値の公表を行う。

（例2） データが追加される度に、オプション等の設定の見直し、季節調整のかけ直しを行い、数値を公表する。

（例3） オプション等の設定は一定期間固定し、データが追加される度に季節調整をかけ直す。一定期間のデータがそろった段階で、オプション等の設定の見直しを行い、季節調整をかけ直す。

（指針4について）

- 4 報告書等には、最低限、主要系列についての情報を掲載する。掲載する内容については、以下のような項目とし、統計利用者が統計作成機関と同一の季節調整を行うことが可能となる情報とする。ただし、主要系列の季節調整値が集計量として求められ、かつ、その下位レベルの系列が非公表の場合については、この限りではない。

- (1) 適用している季節調整法
- (2) 推計に使用しているデータ期間
- (3) 選定したオプション等の内容

なお、報告書等への情報の掲載は、統計作成機関において状況を勘案しながら、可能な限り早期に行うこととし、基本的には、平成9年度末までを目途に行う。

(指針5について)

5 総務庁統計局統計基準部には、別添の様式で情報を提出する。初回の提出は、平成9年度末を目途とし、その後は原則として、季節調整法に関して何らかの変更を行った時点において提出を行うこととする。ただし、統計基準部から連絡があった場合には、この限りではない。

(その他)

6 今後の統計作成機関における検討に際して、季節調整全体に係る問題はもとより、個々の季節調整法の機能等においても共通的に対応すべき問題が生じた場合には、適宜、検討の場を設けることとする。

様 式

季節調整法の適用状況

指数系列又は統計名	
適用している季節調整法	
季節調整法の選定理由	
推計に使用しているデータ期間	
オプション等の選択の基準	
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定の頻度	
備 考	