

季節調整実施系列における調整適用手法（令和5年12月末時点）

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間			データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択					オプション等の見直し		外れ値の設定情報					
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限定するか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂値の改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列別設定外れ値開示の有無	外れ値選択におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項	
																									設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限定するか
内閣府	1	機械受注統計	【月次系列】 需要者別受注額、販売額、受注残高、機種別受注残高、手持月数 【四半期系列】 需要者別受注見通し額(単純集計値)	主要需要者別受注額はX-12-ARIMA、その他はX-12-ARIMAのうちX-11デフォルト	9	直接調整	平17年4月～令4年12月	平17年4月～令5年12月	年1回	暦年のデータが揃った時点	平17年4月～令4年12月	曜日調整(以下「調整」という。)の適否判断とARIMAモデルの選定については、次の通り行っている。まず、調整の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AICが一番小さい候補を採用する。	うるう年調整は行っていない。異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。	×	1. X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いて、外れ値の自動検出を行う(AIRLINEモデル(011)(011)を使用)。 2. 曜日調整(以下「調整」という。)の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AICが一番小さい候補を採用する。 3. 2で採用したARIMAモデルを前提として、outlierコマンドを用いて検出された外れ値を採用する。(検出された外れ異常値の設定を前提としたARIMAモデルの再検討は行わない) 4. .2及び3の結果について新旧比較、グラフで目視確認を行い、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定。なお、rampは設定していない。 5. 結果をまとめ、内閣府のホームページに掲載。 [https://warp.ndl.go.jp/info:ndljp/pid/13024511/www.esri.cao.go.jp/stat/juchu/2023/kicho_u2301.pdf]	○	年1回	暦年のデータが揃った時点	なし	あり	なし	あり	なし	なし	
	2	消費動向調査	【月次系列】 ①消費者態度指数を構成する4つの意識指標(平25年4月から) ②消費者意識指標のうち「資産価値」(平25年4月から)	系列①についてはX-12-ARIMA、系列②についてはX-12-ARIMAのうちX-11デフォルト。	4	直接調整	平16年4月～直近	平16年4月～	年1回	年度のデータが揃った時点	平25年4月～	曜日調整・うるう年調整は行っていない。異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。	×	1. X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いて、外れ値の自動検出を行う(AIRLINEモデル(011)(011)を使用)。 2. 曜日調整(以下「調整」という。)の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AICが一番小さい候補を採用する。 3. 2で採用したARIMAモデルを前提として、outlierコマンドを用いて検出された外れ値を採用する。(検出された外れ異常値の設定を前提としたARIMAモデルの再検討は行わない) 4. .2及び3の結果について新旧比較、グラフで目視確認を行い、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定。なお、rampは設定していない。 5. 結果をまとめ、内閣府のホームページに掲載。 [https://warp.ndl.go.jp/info:ndljp/pid/13024511/www.esri.cao.go.jp/stat/juchu/2023/kicho_u2301.pdf]	○	年1回	毎年3月実施調査の公表時	なし	あり	なし	あり	なし	異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。		
	3	景気動向指数	採用系列のうち、季節調整値が公表されていない、法人税収入及び法人企業統計季報から採用している総資本額(製造業)、雇用者数(非農林業)の計3系列	X-12-ARIMA	3	直接調整	昭50年1月(四半期統計は昭49年第1四半期～)～直近年の12月(四半期統計は直近の四半期)(1)	左記(1)十先行き予測期間	年1回(ただし「総資本額」のデータは四半期毎)	暦年(ただし「総資本額」は四半期のデータが揃った時点)	全期間	曜日調整・うるう年調整(以下「調整」という。)の適否判断とARIMAモデルの選定については、次の通り行っている。まず、調整の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AICが一番小さい候補を採用する。	「総資本額」については曜日調整及びうるう年調整は行っていない。異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。	×	1.Outlier機能で外れ値の自動検出を行う(ARIMAモデルはAirlineモデル(011)(011)を使用)。基本的には自動検出された外れ値を採用。 2.1で検出された外れ値の設定を前提として曜日調整及びうるう年調整の有無の組み合わせごとに、automdコマンドを用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成。次に、候補の中から、各調整の統計的な妥当性をt値等を参考に検証の上、AICが一番小さい候補を採用。(採用されたARIMAモデルを前提としたOutlierコマンドによる外れ値の再検出は基本的には行わないが、X-12-ARIMAの事後診断パートで異常な所見がみられる等の場合は外れ値や曜日うるう年変数の精査を行う) 3.2の結果について新旧比較、グラフで目視確認を行い、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定。なお、rampは設定していない。 6.結果をまとめ、内閣府のホームページに掲載。 [https://www.esri.cao.go.jp/stat/di/di3.html#link004]	×	年1回(ただし「総資本額」のデータは四半期毎)	暦年(ただし「総資本額」は四半期のデータが揃った時点)	なし	あり	なし	あり	なし	なし	
	4	法人企業景気予測調査(財務省と共管)	「貴社の景況判断」BSI(大企業)＜季節調整を行う系列＞ (1)製造業・当期 (2)製造業・翌期 (3)製造業・翌々期 (4)非製造業・当期 (5)非製造業・翌期 (6)非製造業・翌々期 ＜公表系列＞ 全産業、製造業、非製造業 ※「貴社の景況判断」BSI(大企業)の季節調整方法について(法人企業景気予測調査)を参照 https://www.esri.cao.go.jp/stat/hojin/season_kaitai20230613.pdf	X-12-ARIMA	6	間接調整	平16年4～6月期～令5年1～3月期	平16年4～6月期～令6年1～3月期	年1回	年度のデータが揃った時点	全期間	曜日調整・うるう年調整(以下「調整」という。)の適否判断とARIMAモデルの選定については、次の通り行っている。まず、調整の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いてARIMAモデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AICが一番小さい候補を採用する。	曜日調整・うるう年調整は行っていない。異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。	×	1. 異常値検出を、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている(AIRLINEモデル(011)(011)を使用)。 2.1で検出した異常値の設定を前提としてARIMAモデルについて、X-12-ARIMAのモデル選定機能(automdコマンド)を用いて階差及び次数を選定する。(採用されたARIMAモデルを前提としたOutlierコマンドによる外れ値の再検出は行わない) 曜日調整・うるう年調整は行っていない。 3.2の結果について新旧比較、グラフで目視確認を行い、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定。なお、rampは設定していない。 4.決定したARIMAモデルと外れ値をまとめ、内閣府のホームページに掲載する。 [https://www.esri.cao.go.jp/stat/hojin/season_kaitai20230613.pdf]	×	年1回	年度のデータが揃った時点	なし	あり	なし	あり	なし	なし	
	5	四半期別GDP速報	GDP需要項目、名目雇用者報酬	X-12-ARIMA	74	間接調整	平6年Q1～第1次年次推計年Q4まで	平6年Q1～先行き予測期間	公表毎	全期間	全期間	次期1(在庫変動については次数0)の81通りのARIMAモデル((0,1,0)(0,1,0)～(2,1,2)(2,1,2)) (在庫変動については((0,0,0)(0,0,0)～(2,0,2)(2,0,2)))からAIC最小化基準によりモデル選定	「季節調整用ARIMAモデル設定一覧」参照 https://www.esri.cao.go.jp/jp/sna/data/data_list/sokuhou/gaiyou/pdf/model_j.pdf	原則○だが速報期間中は×	1.(011)(011)(在庫は(001)(001))を基本ARIMAモデルとして設定し、Outlier機能で異常値の自動検出を行う。 2.自動検出された異常値のt値を確認するとともにグラフで目視確認を行う。また、自動検出されないRAMPやLPYEARの設定を検討し、統計的な裏付けがあるものについては暫定異常値として設定する。 RAMPを設定する際は、その期間について経済的な実態に照らして説明可能であるかどうかを考慮する。そのうえで、RAMPやLPYEARを設定することとなった場合には、必要に応じて自動検出されたAO、LS、TCを除外する。 3.2の異常値設定を前提として、ARIMAモデルの各項のt値を参考にしつつ左記81通りのARIMAモデルからAICが最小となるモデルを検索する。 4.3の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、異常値のt値を再度確認し、最終的なARIMAモデル及び異常値を決定する。 5.決定した異常値をまとめ、内閣府のホームページに掲載する [https://www.esri.cao.go.jp/sna/data/data_list/sokuhou/gaiyou/pdf/model_j.pdf ※速報期間の対応については「外れ値の設定情報」欄を参照	○	原則年1回、ただし、それ以外にも基礎データの追加入手や遡及改定等に併し随時行う可能性がある。	年次推計時	あり	あり	あり	あり	なし	新型コロナウイルス感染拡大が始まった2020年1-3月以降の四半期においては、リーマンショック時の経験を踏まえ、大半の需要項目等について、先験的に、暫定的な形で異常値処理(AO(加法的な外れ値)ダミーの設定)を行ってきた。その後、一定のデータの蓄積を踏まえ、2022年12月公表の2022年7-9月期2次QE以降、季節調整における異常値処理を見直し、変更した。具体的には、速報期間の異常値処理について、統計委員会国民経済計算体系的整備部会における議論を踏まえ、当面の間、先験的な形では設定せず、各QE時点でX-12-ARIMAの予測系列から外れ値となる場合に暫定的なダミーを置く手法を用いることとした。 [https://www.soumu.go.jp/main_content/000909145.pdf]	

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間		データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択				オプション等の見直し		外れ値の設定情報						
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列別設定外れ値開示の有無	外れ値選択肢におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項
内閣府	6	景気ウォッチャー調査	現状判断DI、先行き判断DI、現状水準判断DI	X-12-ARIMA	60	間接調整	平成14年1月～令和3年12月(1)	左記(1)+12か月	年1回	暦年	平成14年1月以降全期間	AIC等を基準に選定。	異常値に関しては、X-12-ARIMAを用いた定量的な検出に加え、外生事象等を考慮している。	○	1. 暫定ARIMAモデル(011)(011)、OUTLIERコマンドにより、ALL(AO・TC・LS)から外れ値を自動検出(RAMPの設定無し)。 2. 「1」により選択された外れ値を前提に、下記の手順でARIMAモデル及び曜日調整手法を決定。 2-1. 曜日調整変数の候補として、組み込みのTDNOLPYEAR、TD1NOLPYEAR、LPYEAR に加えて、日本の祝日を反映した2通りの休日変数(日曜以外の休日数のカウントによるものとそれに加えてGW・盆・年末年始といった休日をカウントしたものの2通り)を作成し、これらの採用有無の全組み合わせ(20通り)に対してAUTOMDLコマンド(MAXDIFF=(2,1),MAXORDER=(2,2))によりARIMAモデルを選択する。 2-2. 「2-1」で選択された20通りのARIMAモデルについて、曜日・休日調整変数の全てが有意(t>1.96)なものうち、AIC最小のものを採用モデルとする。 3. 「2」のうち採用されたモデルについて、その他経済情勢等を勘案し、外れ値を設定。再度1～2の手順を行う。 4. 「3」のうち検出されたモデルについて、遡及改定幅をグラフで目視確認するとともに、選択されたモデルの前年との差を確認することで、これらの差が最新年のデータに基づく季節調整値の改定として適切と言えることを確認する。 5. 採用されたモデルについて、直近数年の季節指数と予測季節指数の動向をグラフで目視確認し、妥当性を確認。 6. 決定した外れ値やモデルをまとめ、内閣府のホームページに掲載する。	○	年1回	暦年のデータが揃った時点	なし	あり	なし	あり	なし	コロナ禍期間は(2020～2022年)は、緊急事態宣言の発出等によって季節成分と関係しない大きな変動が生じていたため、通常時の自動検出に加え、遡及改定値の改定幅に留意しつつ必要に応じて経済社会情勢に応じた外れ値の設定を検討。 緊急事態宣言の発出、感染者数の増減等による影響がみられる時期を中心に外れ値をあてはめ、前年との差をグラフで目視確認したり、直近数年の季節指数との比較を行い妥当性を検証。
総務省	7	労働力調査	完全失業率等	主要系列についてはX-12-ARIMA、その他の系列についてはX-11	24	直接調整	直近29年分	直近29年分	年1回	1月分結果公表時	直近10年	階差次数・季節階差次数はそれぞれ1に固定し、他の次数は2以下の範囲内でAIC(赤池情報量基準)の最小となるモデルについて、各次数の統計的な有意性を確認した上で選定	総務省統計局ホームページ「季節調整値の算出方法」参照 https://www.stat.go.jp/data/roudou/kisetsu/index.html	○	・外れ値の自動検出結果、有意性、AIC(赤池情報量基準)、季節調整値の改定幅等を系列ごとに検証 ・水準変化を調整する期間と種類については、各系列の季節変動における特性や時系列的変化の背景となる経済実態等に照らして複数の候補を選択し、各候補の事前調整済原系列の推移や統計的な有意性等を比較検証した上で最適と考えられるものを選定 ・過去のARIMAモデルを用いたOutlierコマンドによる外れ値の自動検出結果から洗い出した候補について、グラフの目視確認により必要性を検討し、設定する外れ値を決定。 ・決定された設定外れ値を前提として、ARIMAモデルについては、階差次数・季節階差次数はそれぞれ1に固定し、他の次数は2以下の範囲内の81通りのモデルの中からAIC(赤池情報量基準)の最小となるモデルについて、各次数の統計的な有意性を確認した上で選定 ・選定したARIMAモデルに併せて、設定した回帰変数の有意性を確認し、最終的なARIMAモデルと設定する外れ値を決定。 ・曜日・休日調整及び閏年調整は、行っていない	○	reg-ARIMA 導入系列は年1回。その他は不定期	毎年1月分結果公表時	あり	あり	あり	あり	あり	外れ値の自動検出結果、有意性、AIC(赤池情報量基準)、季節調整値の改定幅等を系列ごとに検証の上、必要な系列に外れ値を新たに設定 [https://www.stat.go.jp/data/roudou/kisetsu/pdf/210302sa.pdf] 水準変化を調整する期間と種類については、各系列の季節変動における特性や時系列的変化の背景となる経済実態等に照らして複数の候補を選択し、各候補の事前調整済原系列の推移や統計的な有意性等を比較検証した上で最適と考えられるものを選定 [https://www.stat.go.jp/data/roudou/kisetsu/pdf/121228sa.pdf]
	8	家計調査	①二人以上の世帯の主要項目(月次) ②総世帯、二人以上の世帯、単身世帯の主要項目(四半期)	二人以上の世帯の主要項目(月次・四半期)及び総世帯及び単身世帯の主要項目についてはX-12-ARIMA、その他の系列についてはX-11	41	直接調整(ただし、平均消費性向については間接調整。)	平成12年1月～	モデル推計に使用している原系列データ期間+12か月(X-11パートの予測季節指数)	年1回	1月分公表時	全期間(平成12年1月から)	AIC値による比較を可能とするために、AIRLINEモデル(011)(011)の階差(d,D=1)に固定した。その上で、回帰変数(閏年、曜日、休日、月末の曜日)とARIMAモデル(p, P, q, Qを0, 1, 2とする組合せ)の組合せから、AIC値最小を選択した。ただし、本来あるべきでない回帰変数が現れたモデル、曜日回帰変数を指定しているにもかかわらずX-12-ARIMAのスペクトラム分析で曜日を周期とする変動が残っているモデルを除外した。さらに、閏年回帰変数の係数が過大である場合は、回帰変数から事前調整方式に変更した。その後、外れ値の自動検出機能により、外れ値の指定を行っている。	「ARIMAモデルの選択基準又は選択結果」を参照。	○	1. 曜日回帰変数を12か月分更新する 2. 過去のモデルを暫定ARIMAモデルとして設定し、1の曜日回帰変数を設定の上、Outlier機能で外れ値の自動検出を行う 3. 自動検出結果について、自動検出された外れ値のt値を確認する。あわせて、グラフの目視確認を行う。 これらの確認においては社会的要因を参考にし、また、自動検出されないRampなどの設定を検討し、暫定外れ値とする。 Rampを設定する際は、その期間について社会的要因を参考にするとともに、必要に応じて自動検出されたAO、LSを除外する 4. 1～3で設定した外れ値を前提として、AIC、ARIMAモデルの各項のt値を参考に、必要に応じて過去のARIMAモデルの継続使用妥当性を検討する。 5. 4の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、外れ値のt値を再度確認し、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 6. 決定した外れ値をまとめ、統計局のホームページに掲載する [https://www.stat.go.jp/data/kakei/longtime/pdf/ARIMA.pdf]	○	【二人以上の世帯の主要項目(月次)等(X-12-ARIMA)について】 年1回(外れ値のみ) 5年に1回(予定)(全体的な見直し)	前年12月分値までの原系列値により1～12月分値の予測季節指数算出時(外れ値のみ)	あり	あり	あり	あり	あり	1. 通常時の自動検出に加え、必要に応じて、コロナ禍の経済情勢に応じた外れ値の設定を検討 2. 1の内容をグラフで目視確認し、自動検出されないRampなどの外れ値を検討 3. 1及び2の検討結果について有識者に相談 4. 有識者の意見を参考に最終的な外れ値を決定
	9	消費動向指数	①世帯消費動向指数-基本系列(総世帯、二人以上の世帯、単身世帯)(月次、四半期) ②世帯消費動向指数-分布調整値(総世帯、二人以上の世帯)(月次、四半期)	X-12-ARIMA	168月次162、四半期162	直接調整	平成14年1月～	モデル推計に使用している原系列データ期間+12か月(X-11パートの予測季節指数)	年1回	1月分公表時	全期間(平成14年1月から)	ARIMAモデルについては、AICや各次数の統計的な有意性を考慮した上で選定した。	回帰変数(閏年、曜日、休日、月末の曜日)は家計調査の二人以上世帯と同一としている。	○	1. 曜日回帰変数を12か月分更新する 2. 過去のモデルを暫定ARIMAモデルとして設定し、1の曜日回帰変数を設定の上、Outlier機能で外れ値の自動検出を行う 3. 自動検出結果について、自動検出された外れ値のt値を確認する。あわせて、グラフの目視確認を行う。 これらの確認においては社会的要因を参考にし、また、自動検出されないRampなどの設定を検討し、暫定外れ値とする。 Rampを設定する際は、その期間について社会的要因を参考にするとともに、必要に応じて自動検出されたAO、LSを除外する 4. 1～3で設定した外れ値を前提として、AIC、ARIMAモデルの各項のt値を参考に、必要に応じて過去のARIMAモデルの継続使用妥当性を検討する。 5. 4の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、外れ値のt値を再度確認し、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 6. 決定した外れ値をまとめ、統計局のホームページに掲載する [https://www.stat.go.jp/data/cti/pdf/micro_ref_2020.pdf]	○	年1回(外れ値のみ) 5年に1回(予定)(全体的な見直し)	前年12月分値までの原系列値により1～12月分値の予測季節指数算出時(外れ値のみ)	あり	あり	あり	あり	あり	1. 通常時の自動検出に加え、必要に応じて、コロナ禍の経済情勢に応じた外れ値の設定を検討 2. 1の内容をグラフで目視確認し、自動検出されないRampなどの外れ値を検討 3. 1及び2の検討結果について有識者に相談 4. 有識者の意見を参考に最終的な外れ値を決定

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間		データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択					オプション等の見直し		外れ値の設定情報					
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及と改訂値の改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列設定外れ値開示の有無	外れ値選択におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項
総務省	10	消費者物価指数	全国及び都区部の ①「総合」 ②「生鮮食品を除く総合」 ③「生鮮食品及びエネルギーを除く総合」 ④「財」 ⑤「サービス」	X-12-ARIMA	13	直接調整	平22年1月～	基準年の10年前(前々基準の基準年)から最新年まで	年1回	12月分結果公表時	全期間	階差次数・季節階差次数はそれぞれ1に固定し、他の次数は2以下の範囲内で考えられる組み合わせのうち、各次数の統計的な有意性を確認した上で、AICの最小となるモデルを選定した。	総務省統計局ホームページ「2020年基準 消費者物価指数の解説」参照 https://www.stat.go.jp/data/cpi/2020/kaisetsu/index.htm#p3-7	○	(1)外れ値を設定しないARIMAモデル(0 1 1)(0 1 1)で、全てのデータ期間を対象にOutlierコマンドによる外れ値の自動検出を行う。 (2)自動検出された外れ値候補について、その有意性に加えて、背景となる経済状況や制度変更等も確認した上で、外れ値候補を選定する。 (3)系列ごとに(2)で選定した外れ値候補を回帰変数に設定した上で、計81通りのARIMAモデル※の中からAIC最小化基準に基づきARIMAモデルを選定する(※ARIMAモデルの階差・季節階差は1に固定、他の次数は2以下の組み合わせの計81通り)。 (4)(3)で選定されたモデルでの外れ値候補の有意性や季節調整値の推移等を確認した上で、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する。	○	年1回 (ARIMAモデル及び外れ値のみ) 5年に1回(予定)(全体的な見直し)	毎年12月分結果公表時	あり	あり	なし	あり	なし	左記に記載の外れ値設定方法によって対応している(特段に追加的に配慮した事項はなし)。
財務省	11	法人企業統計調査(四半期別調査)	売上高、営業利益、経常利益、設備投資(ソフトウェアを除く)、設備投資(ソフトウェア)	X-12-ARIMA	10	間接調整	昭60年4-6月期以降	昭60年4-6月期以降	年4回	毎調査期	始期(昭60年4-6月期)に遡り、改定を行っている。	階差次数及び季節階差次数1の81通りのARIMAモデル(0,1,0)(0,1,0)～(2,1,2)(2,1,2)から季節調整値の安定性に配慮しつつ、AIC値最小化基準によりモデルを選定。 四半期別法人企業統計調査報道発表資料P.19「四半期別法人企業統計調査の季節調整方法について」参照 (https://www.mof.go.jp/pri/reference/ssc/results/r4.10-12.pdf)	○	(1)リーマン・ショック、東日本大震災、消費税導入、新型コロナウイルス等の事象に対応する異常値について過去の検討により導入された回帰変数の継続使用を前提とし、毎年、左記手順によりARIMAモデルの選定を行う。なお選定の際、モデルの順位付けでは、現行のモデルが与える結果からの平均乖離幅が一定の範囲に収まるモデルの中で、AICによる比較を行う。 (2)新型コロナウイルス等の新たな事象に対応して異常値に対応する回帰変数を新たに追加設定する際は、有識者の知見をいただきながら、 (i)データの動きから候補となる回帰変数をリストアップし、当該候補回帰変数と左記手順記載の81通りのモデルの組合せについてすべてAICを計算し、すべての組合せの中でもっともAICを最小化する回帰変数とモデルの組合せを採用する。(東日本大震災に対応するダミー変数の導入検討手法) (ii)直近で採用されていたARIMAモデルに対して、データの動きからリストアップした回帰変数候補について、それぞれを設定した場合の回帰変数の有意性(値評価)を確認した上で、AICを比較。その上で、設定した時点前後における水準の変化による追加設定の再検討の必要性の観点からAOとRampを比較検討し、回帰変数を決定。 (新型コロナウイルスの感染拡大に対応するダミー変数の導入検討手法) (3)異常値に対応する回帰変数の検討は、(1)列記の様な明らかに必要性が考えられるものを対象としており、outlierコマンドを利用したデータからの検出はしていない。 等の手順で、毎年、回帰変数を決定し、決定された回帰変数の使用を前提として、左記手順により81通りのARIMAモデルの中から選定を行う。 法人企業統計調査を利用した分析等 https://www.mof.go.jp/pri/reference/ssc/bunseki.htm	○	年1回	年度のデータが揃った時点	なし	あり	あり	あり	あり	新型コロナウイルスの経済に対する影響が大きく広がっており、法人企業統計においても、2020年以降に新型コロナウイルスの影響と考えられる不規則な変動が複数の系列で観察され、リーマンショックのように標準的なARIMAモデルでは対応できない急激な変動があると判断し、2020年4-6月期に各系列で大きな下落が見られたため、その周辺の変動に対する適当な変数の設定を有識者の知見をいただきながら検討し2021年4-6月期結果公表(2021年9月1日)以降に用いるX-12ARIMAスペックについてRAMP変数を設定した。(法人企業統計研究会において(2021年4月12日、同6月28日の2回に渡り検討) [法人企業統計研究会 https://www.mof.go.jp/pri/reference/ssc/summary/kenkyukai.htm]	
	12	貿易統計	輸出入額	X-12-ARIMA	2	直接調整	120か月	120か月	毎月	統計発表時	120か月	階差および季節階差をそれぞれ1に固定した合計81通りのモデル候補すべての推定を行い、「最適モデルのAIC - 現行モデルのAIC」が最小となるモデルを以下のとおり選択した。 輸出(110)(210) 輸入(212)(211)	×	毎年、外部専門家に委託し、貿易統計の系列に比較的大きな影響を与えそうな事象について、外れ値による新たな変数の導入を検討している。外部専門家の知見による外れ値の設定を前提として、税制改正、新型コロナウイルスによる変動等、過去の検討により導入された回帰変数の継続使用を前提とし左記81通りのARIMAモデルの中からARIMAモデルの選定を行う。なお、選定におけるモデルの順位付けでは、最適モデルのAICと現行モデルのAICとの差が最小となるモデルを選択している。	×	年1回	歴年のデータが揃った時点	なし	あり	あり	なし	あり	新型コロナウイルスによる影響に伴う変動は検討の際、外部専門家により考慮	
	13	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)、その他第一次所得(受)、その他第一次所得(払)、第二次所得(受)、第二次所得(払) ※「その他第一次所得」は、明確な季節性が認められないことから、季節調整済数は原計数によって代替。	X-12-ARIMA	20	直接調整	平8年1月～	平8年1月～	年2回	各系列の直近12月速報が公表された時点、及び同計数の第二次速報が公表された時点	全データについて遡及改定を行う。なお、先行き1年分については、季節要素の予測値を用いて季節調整済値を計算。 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(原則として、階差1、AR項及びMA項をそれぞれ0～2とした計81通りのモデルからAIC値が最小のものを採用)。 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。事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ、曜日調整変数等を設定する。	○	1.曜日効果を考慮した稼働日調整構文のほか、輸出・輸入に関しては通関日数を考慮するため、ユーザー定義変数を用意する。 2.各系列において、前年採用した稼働日調整構文、外れ値およびそれらを前提として81通りのモデルの中からautomdコマンドにより自動作成により採用したARIMAモデルを暫定ARIMAモデルとし、デフォルト設定のOutlier機能で外れ値の自動検出を行う。 3.自動検出結果について、新たに加えた期間の外れ値が検出された際には、その経済的背景を特定することができる場合、外れ値とすることを検討する(既存の外れ値については変更しない)。 また、新型コロナウイルス禍といった大きな社会情勢の変化が生じた際には、自動検出されないRamp、LSの設定を検討し、妥当性を確認のうえ外れ値とする(必要に応じて自動検出されたAO、TCは除外)。 4.3で決定した外れ値を設定したうえで、3通りの稼働日調整構文を用いてそれぞれ左記81通りのモデルの中からautomdコマンドを用いてARIMAモデルを自動作成し、モデルのAIC値、季節性の有無を判断するF検定の結果、Ljung-BoxのQ統計量等をもとに総合的に採用モデルを判断。 5.4の結果についてグラフで目視確認を行い、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 6.モデル・オプション設定一覧をまとめ、日本銀行のホームページに掲載する 直近の掲載【https://www.boj.or.jp/statistics/outline/notice_2023/not230511a.htm】	×	年2回 [令和6年から年1回(毎年5月(年次改訂ベース))に変更予定。]	各系列の直近12月速報が公表された時点、及び同計数の第二次速報が公表された時点 [令和6年から「各系列の直近12月までの第二次速報が公表された時点」に変更予定]	なし	あり	あり	あり	なし	1.旅行(受)(払)において、コロナ禍の経済情勢に応じた外れ値の設定を検討するため、通常時の自動検出(AO/TC)にRamp、LSを追加し、検討 2.1で自動検出された外れ値をグラフで目視確認し、当該外れ値が、日本の水際対策の緩和などの旅行者数に影響を及ぼす経済情勢の変化によって説明可能であることを確認したうえで、最終的な外れ値を決定		

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間			データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択					オプション等の見直し		外れ値の設定情報					
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂値の改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列別設定外れ値開示の有無	外れ値選択におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項	
厚生労働省	14	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のうちX-11デフォルト	0	入・離職率は間接調整、その他は直接調整				年1回	12月までのデータが揃った時点	始期に遡り改定						不定期	なし	-	-	-	-	毎月勤労統計調査の改善に関するワーキンググループにおいて、季節調整法について検討を行い、以下のようにとりまとめられた。 (検討の方向性) 毎月勤労統計調査における季節調整値は、これまでX-12-ARIMAのX-11による移動平均パートのみ適用して作成していたが、特に令和2年、3年のデータには、新型コロナウイルス感染症の影響により、通常とは異なる大きな変動が含まれていることから、外れ値処理などが可能なREGARIMAによる事前調整を適用することで安定性が向上する可能性がある。そのため、X-11による移動平均パートのみを適用した場合と、REGARIMAによる事前調整を行った上でX-11による移動平均パートを適用した場合で、季節調整値がどう変化するかや安定性が向上するか等を検証し今後の季節調整値の作成方法を検討した。 (検討結果) 安定性の向上が確認できたことからX-12ARIMAに移行する。X-12-ARIMAへ移行後の実務においては、他の統計調査における取扱いや実務面などを考慮し、季節調整値を作成するのは、政府統計の総合窓口(e-Stat)に季節調整値の長期時系列表を掲載している主要32系列とし、直近28年分とする。 (毎月勤労統計調査の改善に関するワーキンググループ報告書 https://www.mhlw.go.jp/stf/newpage_37679.html) [第203回統計委員会資料6 毎月勤労統計調査の改善に関するWG報告書について https://www.soumu.go.jp/main_content/000933965.pdf]	
	15	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のうちX-11SeasonalMSR	0	「増加・減少」及び「増加加工」系列については間接調整、その他の系列は直接調整。				年1回	11月調査のデータがそろった時点	始期に遡り改定						不定期	なし	-	-	-	-		
厚生労働省	16	職業安定業務統計	新規求人数・新規求職申込件数・有効求人数・有効求職者数・就職件数	X-12-ARIMA	302	直接調整である。なお、求人数と求職者数の合成系列である求人倍率の季節調整値については、求人数の季節調整値を求職者数の季節調整値で除して算出している。	直近10年	直近56年及び先行予測期間	年1回	1月分公表時(2月下旬または3月上旬)	5年		階差次数及び季節階差次数1の81通りのARIMAモデル(0,1,0)(0,1,0)~(2,1,2)(2,1,2)から、AICC値最小化基準によりモデルを選定。	曜日効果について、日本の祝日等を考慮したJpDaysと称する以下の8個の変数をARIMAモデルの説明変数として導入している。 DjpMon=祝祭日等でない月曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpTue=祝祭日等でない火曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpWed=祝祭日等でない水曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpThu=祝祭日等でない木曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpFri=祝祭日等でない金曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpSat=祝祭日等でない土曜日の数-日曜日の数-一定数 DjpHS=土曜日と重なる祝祭日等の数-日曜日の数-一定数 DjpHnotSS=土日と重ならない祝祭日等の数-日曜日の数-一定数 (各定数は、長期的に各説明変数の月あたりの平均値が0になるよう定める数。) X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いて自動的に異常値候補を検出。異常値として処理されるべき経済的背景がはっきりしているもののみ、異常値として処理。経済的背景の事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ等を設定した。	○	1.祝日の変更など、必要に応じて左記のJpDaysの変数を更新する 2.過去のモデルを暫定ARIMAモデルとして設定し、1の設定の上、Outlier機能で外れ値の自動検出を行う 3.自動検出結果について、自動検出された外れ値のt値を確認する。あわせて、グラフの目視確認を行う。 これらの確認においては社会的要因を参考にするとともに、自動検出されないRampなどの設定を検討し、暫定外れ値とする。 Rampを設定する際は、t値を確認したうえでその期間について社会的要因を参考にするとともに、必要に応じて自動検出されたAO、LS、TCを除外する 4.AIC、ARIMAモデルの各項のt値を参考に、必要に応じてARIMAモデルの妥当性を検討する。 5.4の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、外れ値のt値を再度確認し、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 6.決定したARIMAモデルと外れ値をまとめ、厚生労働省のホームページに掲載する [https://www.mhlw.go.jp/toukei/list/114-1c3.html]	○	年1回	1月分結果公表時	なし	あり	あり	あり	あり	通常時の自動検出に加え、必要に応じて、コロナ禍の経済情勢に応じた外れ値の設定を検討

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間		データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択				オプション等の見直し		外れ値の設定情報								
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂値の改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックルファイルの開示の有無	系列別設定外れ値開示の有無	外れ値選択肢におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項		
厚生労働省	17	雇用保険業務統計	雇用保険受給資格決定件数、受給者実人員数、資格取得者数、資格喪失者数、被保険者数	X-12-ARIMA	8	直接調整	直近15年間	直近15年間+12か月	年1回	4月分公表時(5月下旬)	5年		採用したARIMAモデルを用いて、X-12-ARIMAのOUTLIERコマンドにより、異常値を探索する。検出された異常値のうち、異常値として処理されるべき制度改正・経済的背景がはっきりしているもののみ、異常値として処理。制度改正・経済的背景の事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ等を設定した。曜日・うるう年調整変数や日本の祝日等を考慮したユーザー型回帰変数を採用し設定した。		○	1.曜日回帰変数を12か月分更新する 2.「ARIMAモデルの選択基準又は選択結果」で決定したARIMAモデルとして設定し、1の曜日回帰変数を設定の上、Outlier機能で外れ値の自動検出を行う 3.自動検出結果について、自動検出された外れ値のt値を確認する。あわせて、グラフの目視確認を行う。 これらの確認においては社会的要因を参考にし、また、自動検出されないRampなどの設定を検討し、暫定外れ値とする。 Rampを設定する際は、t値を確認したうえでその期間について社会的要因を参考にするとともに、必要に応じて自動検出されたAO、LS、TCを除外する 4.外れ値のt値を再度確認し、最終的な外れ値を決定する 5.決定したARIMAモデルと外れ値をまとめ、厚生労働省のホームページに掲載する [https://www.mhlw.go.jp/toukei/list/dl/150-1-01.pdf]	○	年1回	毎年度4月実績公表時	あり(予定)	あり	あり	あり	あり	あり	通常時の自動検出に加え、コロナ禍の経済情勢に応じた外れ値の設定を検討
経済産業省	18	鉱工業指数	生産、出荷、在庫、在庫率、稼働率、生産予測	X-12-ARIMA	177	直接調整	144か月	144か月+14か月	年1回	年間補正時及び5年毎の基準改定時	前年1年間及び当年		(i) ARIMAモデルの通常階差、季節階差を1次に固定し、AR項、MA項の次数選定は、モデルの複雑さを回避するため、選定対象を0次から2次までの間で選定。 (ii) 鉱工業、業種分類及び財分類について、曜日、祝祭日、うるう年調整などの各種オプションを考慮の上、各種設定の統計的な優位性及び各原系列の持つ特性を踏まえ、BIC(ベイズ情報量規準)の値が最小となるものを基本にARIMAモデルを設定。 (注)オプションやARIMAモデルは、2015年基準までは、鉱工業で設定したものを全ての系列へ適用していたが、2020年基準より、業種分類及び財分類ごとに設定	曜日調整(2曜日調整)、祝祭日調整(カレンダーよりユーザー型回帰変数を利用)、うるう年調整の適用有無を、鉱工業、業種分類及び財分類ごとに判断し、設定。 異常値は、定期的(基準改定及び年間補正時)にoutlierコマンドによって全てのタイプの異常値を検出する。原則として検出された全ての異常値を取り入れるが、必要に応じて、経済事象や系列の性質を考慮した上で、暫定季節指数の安定性に関する検証等を行い、異常値の検出期間の設定や、異常値のタイプ等を調整する。	×	(a)5年程度間隔で実施する基準改定における外れ値・ARIMAモデルの決定手順 左記手順により決定したARIMAモデル及び曜日、祝祭日、うるう年調整などの各種オプションを前提にoutlierコマンドによって検出される異常値を採用(検出された異常値を前提としたARIMAモデルの再検討は実施しない)。 (b)毎年のARIMAモデル外れ値・ARIMAモデルの決定手順 (i) ARIMAモデル及び曜日調整、祝祭日調整、うるう年調整等の各オプションの設定は、2020年基準指数の公表期間内は固定 (ii) 毎年、季節指数計算を行う際に改めてのoutlierコマンドを使用し検出を行い、最新のデータを反映させた処理を行う。 [鉱工業指数2020年基準改定の概要] https://www.meti.go.jp/statistics/tyo/rip/pdf/b2020_kaitei_gaiyo.pdf	×	5年に1回	5年毎(基準改定時)、西暦末年が0及び5の年	異常値は、年間補正のたびに新たな1年を追加して検出、検討を行った上で、設定。	あり	あり	なし	あり	なし	左記に記載の外れ値設定方法以外に追加的に配慮した事項はなし。
	19	第3次産業活動指数		X-12-ARIMA	大分類11系列、全系列281系列	「第3次産業総合」は間接調整。それ以外の系列は、直接調整。	120か月	120か月+14か月	年1回	年間補正時(毎年4月中旬)及び5年毎の基準改定時	前年1年間及び当年		階差は標本ACF、PACFにより判断、ARとMAは次数0~2のARIMAモデル(混合及び部分混合を除く)に、各事前調整変数の組み合わせパターンを加えた全てのモデルから、AIC値、変数の優位性、過剰階差や基データの性質、モデルの堅牢性等などを鑑み総合的に判断。	内部生成変数とユーザー変数(日本型祝祭日など)を用い、左記のとおりRegARIMAモデルを設定。 異常値は、自動検出機能により観測値投入期間(120時点)に対し各種異常値(a)を指定)を検出する。閾値はデフォルト。原則として検出された全ての異常値を取り入れる。	×	(a)5年程度間隔で実施する基準改定における外れ値・ARIMAモデルの決定手順 左記手順により決定したARIMAモデル及び曜日、祝祭日、うるう年調整などの各種オプションを前提にoutlierコマンドによって検出される異常値を採用(検出された異常値を前提としたARIMAモデルの再検討は実施しない)。 (b)毎年のARIMAモデル外れ値・ARIMAモデルの決定手順 (i) ARIMAモデル及び曜日調整、祝祭日調整、うるう年調整等の各オプションの設定は、2015年基準指数の公表期間内は固定 (ii) 毎年、季節指数計算を行う際に改めてのoutlierコマンドを使用し検出を行い、最新のデータを反映させた処理を行う。 [第3次産業活動指数2015年基準改定の概要] https://www.meti.go.jp/statistics/tyo/sanji/result/pdf/b2015_ITA_ovvj.pdf	×	5年に1回	5年毎(基準改定時)、西暦末年が0及び5の年	異常値は、年間補正のたびに新たな1年を追加して検出、検討を行った上で、設定。	あり	なし	なし	あり	なし	左記に記載の外れ値設定方法以外に追加的に配慮した事項はなし。
経済産業省	20	商業動態統計調査	(商業販売、百貨店・スーパー販売、コンビニエンスストア販売)	X-12-ARIMA	45	直接調整	8年	8年+1年	年1回	毎年1月分分報公表時	前年1年間及び当年		情報量基準比較やパラメータの有意性をもとに系列ごとにモデルやオプションを最適なスペックに更新	左記に同じ	×	(a) 5年おきなどの外れ値・ARIMAモデルの決定手順 1. ARIMAモデルを標準的なモデル(Airlineモデル(011)(011))に固定し(暫定ARIMAモデル)、回帰変数(曜日・うるう年・祝祭日(カレンダー要因))の組み合わせを情報量基準(AIC)で順位付ける。 2. 上記1.で情報量基準が最小であった回帰変数とAirlineモデルに対して外れ値(outlier)を自動検出機能で検出する(仮外れ値)。 3. 2.で検出された仮外れ値を回帰変数として取り入れ、情報量基準が最小であったARIMAモデル※を決定する。ただし、このモデルにおいて設定されている回帰変数が有意でなかった場合(t値を参考に妥当性を判断)は、1.で次に順位付けられた回帰変数の組み合わせに関する、2.以降を実施する(※階差(d,D)は1に固定、(p, P, q, Q)は0, 1, 2とする81通りの組合せのなかから決定する)。 4. ARIMAモデルが変わったことにより外れ値が変わる可能性があるため、再び外れ値を自動検出機能で検出し、最終的な外れ値とする(自動検出されないRampの利用や外れ値の決め打ちは行わない)。 (b) 毎年の外れ値・ARIMAモデルの決定手順 ・毎年の外れ値の検出はOutlierコマンドで自動検出する。 ・ARIMAモデルは5年に一度の基準改定時に更新する(毎年更新しない)。 [平成23年度商業動態統計調査の調査手法等に関する調査研究季節調整方法に関する検討報告書 https://dl.ndl.go.jp/pid/11240323]	×	5年に1回、ただし外れ値は年1回	基準改定時(西暦末年が0及び5の年)	あり	あり	なし	あり	なし	なし	

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間		データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択				オプション等の見直し		外れ値の設定情報						
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂値の改訂幅が抑制されるよう配慮するか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列設定外れ値開示の有無	外れ値選択肢におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナ感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項	
国土交通省	21	建築着工統計調査		X-12-ARIMA	19	間接調整	平2年1月～	モデル推計に使用している原系列データ期間+12か月	年1回	毎年12月値公表後	平2年1月まで遡及	モデル次数はAUTOMDLコマンドで自動選定。その際、標準型曜日調整、2曜日型曜日調整、うるう年調整、祝祭日(慣例休日含まない)、祝祭日(慣例休日含む)のうち、有意となる組み合わせがある場合、AICが最小となるものを採用。	異常値は、(011)(011)モデルにおいてOUTLIERコマンドを用いてAO・TC・LSを自動選定。	×	1. 暫定ARIMAモデル(011)(011)、暫定外れ値なしの下、OUTLIERコマンドにより、ALL(AO・TC・LS)から外れ値を自動選定(RAMPの設定なし) 2. 「1」により選択された外れ値を前提に、以下の手順でARIMAモデル及び曜日調整手法を決定。 2-1. 曜日調整変数の候補として、組み込みのTDNOLPYEAR、TD1NOLPYEAR、LPYEARに加えて、日本の祝日を反映した2通りの休日変数(日曜以外の休日数のカウントによるものとそれに加えてGW・盆・年末年始といった休日もカウントしたものの2通り)を作成し、これらの採用有無の全組み合わせ(20通り)に対してAUTOMDLコマンド(MAXDIFF=(2,1), MAXORDER=(2,2))によりARIMAモデルを選択する。 2-2. 「2-1」で選択された20通りのARIMAモデルについて、曜日・休日調整変数の全てが有意(t>1.96)なもののうち、AIC最小のものを採用モデルとする。 3. 「2」により採用されたモデルについて、遡及改定幅をグラフで目視確認するとともに、選択されたモデルの前年との差を確認することで、これらの差が最新年のデータに基づく季節調整値の改定として適切と言えることを確認する。 4. 「2」により採用されたモデルについて、直近数年の季節指数と予測季節指数の動向をグラフで目視確認するとともに、品質評価統計量を確認することで、採用されたモデルの当該系列の季節調整方法としての妥当性及び作成された予測季節指数の当該系列の季節調整方法としての実用性を確認する。	×	年1回	毎年12月値公表後	なし	なし	なし	あり	なし	各系列において、新型コロナウイルス感染症の影響を原数値グラフ目視及び左記の季節調整結果の通常の確認手順により確認したところ、OUTLIERコマンドによる外れ値自動選択の適切性に影響を及ぼすと考えられる断続的かつ中長期に渡る外れ値的な振る舞い及びOUTLIERコマンドによる不適切な外れ値の選択があったとは考えられなかったことから、新型コロナウイルス感染症発生以前と同様の季節調整手順に則った。
	22	建設工事受注動態統計(50社)		X-12-ARIMA	9	間接調整	昭61年1月～	モデル推計に使用している原系列データ期間+12か月	年1回	毎年12月値公表後	昭61年1月まで遡及	モデル次数はAUTOMDLコマンドで自動選定。その際、標準型曜日調整、2曜日型曜日調整、うるう年調整、祝祭日(慣例休日含まない)、祝祭日(慣例休日含む)のうち、有意となる組み合わせがある場合、AICが最小となるものを採用。	異常値は、(011)(011)モデルにおいてOUTLIERコマンドを用いてAO・TC・LSを自動選定。	×	1. 暫定ARIMAモデル(011)(011)、暫定外れ値なしの下、OUTLIERコマンドにより、ALL(AO・TC・LS)から外れ値を自動選定(RAMPの設定なし) 2. 「1」により選択された外れ値を前提に、以下の手順でARIMAモデル及び曜日調整手法を決定。 2-1. 曜日調整変数の候補として、組み込みのTDNOLPYEAR、TD1NOLPYEAR、LPYEARに加えて、日本の祝日を反映した2通りの休日変数(日曜以外の休日数のカウントによるものとそれに加えてGW・盆・年末年始といった休日もカウントしたものの2通り)を作成し、これらの採用有無の全組み合わせ(20通り)に対してAUTOMDLコマンド(MAXDIFF=(2,1), MAXORDER=(2,2))によりARIMAモデルを選択する。 2-2. 「2-1」で選択された20通りのARIMAモデルについて、曜日・休日調整変数の全てが有意(t>1.96)なもののうち、AIC最小のものを採用モデルとする。 3. 「2」により採用されたモデルについて、遡及改定幅をグラフで目視確認するとともに、選択されたモデルの前年との差を確認することで、これらの差が最新年のデータに基づく季節調整値の改定として適切と言えることを確認する。 4. 「2」により採用されたモデルについて、直近数年の季節指数と予測季節指数の動向をグラフで目視確認するとともに、品質評価統計量を確認することで、採用されたモデルの当該系列の季節調整方法としての妥当性及び作成された予測季節指数の当該系列の季節調整方法としての実用性を確認する。	×	年1回	毎年12月値公表後	なし	あり	なし	あり	なし	各系列において、新型コロナウイルス感染症の影響を原数値グラフ目視及び左記の季節調整結果の通常の確認手順により確認したところ、OUTLIERコマンドによる外れ値自動選択の適切性に影響を及ぼすと考えられる断続的かつ中長期に渡る外れ値的な振る舞い及びOUTLIERコマンドによる不適切な外れ値の選択があったとは考えられなかったことから、新型コロナウイルス感染症発生以前と同様の季節調整手順に則った。
日本銀行	23	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	2	直接調整	昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月	年1回	直近12月までのデータが揃った時点	新たに季節調整済値を求める全期間にかけて遡及改定を行う。なお、先行き1年分については、季節要素の予測値を用いて季節調整済値を計算。	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。	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。事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ、曜日調整変数等を設定する。	○	毎年の外れ値・ARIMAモデルの決定手順は下記1～6のとおり。 1. 原計数の動きと制度変更等からランプやレベルシフト等の暫定外れ値の候補を洗い出す。洗い出した暫定外れ値候補の設定を前提としてX-12-ARIMAのautomdlコマンドによる自動選択機能から決定される暫定ARIMAモデルを利用し、暫定外れ値の有意性(t値)を確認し設定する外れ値を確定する 2. 未残の系列は、カレンダー要因の外れ値の設定を行う 3. 過去のモデルや1.の暫定ARIMAモデルを参考に階差、AR、MA項の範囲を決定し、これらの複数のモデル候補から、左記の基準に沿って各モデルの妥当性を検討する 4.3.の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 5. 決定されたARIMAモデルを用いてoutlierコマンドにより自動検出した外れ値について、有意性(t値)などを確認したうえで確定する。 6. 決定した外れ値やARIMAモデル等をまとめ、日本銀行のホームページに掲載する [https://www.boj.or.jp/statistics/outline/notice_2023/not230207a.pdf]	×	年1回	直近12月までのデータが揃った時点	なし	あり	あり	なし	なし	なし

府省等名	番号	統計名	季節調整対象系列	X-13ARIMA-SEATS、X-12-ARIMA又はX-11の別	X-12-ARIMAの事前調整機能利用季節調整系列数	直接調整又は間接調整の別	データ期間			データ追加に伴う季節調整値の改定頻度			オプション等選択				オプション等の見直し		外れ値の設定情報						
							モデル推計に使用する期間	季節指数を求めめる期間	頻度	時期	遡及期間	ARIMAモデルの選択基準又は選択結果	回帰変数の選択基準又は選択結果	設定外れ値を経済状況・制度変更等で説明可能なものに限るのか	ARIMAモデルと外れ値の組合せ決定調整手順	ARIMAモデルと回帰変数の組合せ決定の際に過去値遡及改訂値の改訂幅が抑制されるか	頻度	時期	スペックファイルの開示の有無	系列別設定外れ値開示の有無	外れ値選択肢におけるRAMP設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中の外れ値設定の有無	コロナ期間(2020年以降)中のRAMP設定の有無	新型コロナウイルス感染症の影響に対応し、外れ値設定設定の検討の際、従来対応に加えて配慮した事項	
日本銀行	24	マネーストック	M2平残	X-12-ARIMA	9	直接調整	昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月	原則年1回	直近12月までのデータが揃った時点	マナーサプライ統計からマネーストック統計に移した平15年4月以降について遡及改定を行う。なお、先行き1年分については、季節要素の予測値を用いて季節調整済値を計算。	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。	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。事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ、曜日調整変数等を設定する。	○	毎年の外れ値・ARIMAモデルの決定手順は下記1～6のとおり。 1.原計数の動きと制度変更等からランプやレベルシフト等の暫定外れ値の候補を洗い出す。洗い出した暫定外れ値候補の設定を前提としてX-12-ARIMAのautomdlコマンドによる自動選択機能から決定される暫定ARIMAモデルを利用し、暫定外れ値の有意性(t値)を確認し設定する外れ値を確定する。 2.未残の系列は、カレンダー要因の外れ値の設定を行う 3.過去のモデルや1.の暫定ARIMAモデルを参考に階差、AR、MA項の範囲を決定し、これらの複数のモデル候補から、左記の基準に沿って各モデルの妥当性を検討する 4.3の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する 5.決定されたARIMAモデルを用いてoutlierコマンドにより自動検出した外れ値について、有意性(t値)などを確認したうえで確定する。 6.決定した外れ値やARIMAモデル等をまとめ、日本銀行のホームページに掲載する [https://www.boj.or.jp/statistics/outline/notice_2023/not230309a.htm]	×	原則年1回	直近12月までのデータが揃った時点	なし	あり	あり	あり	なし	なし	
			M3平残、M3末残				平8年1月～令4年12月	平8年1月～令4年12月														あり	なし	なし	
			M1平残、M1末残				昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月														あり	なし	なし	
			現金通貨平残				昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月														あり	なし	なし	
			預金通貨平残				昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月														あり	なし	なし	
			準通貨平残				昭42年1月～令4年12月	昭42年1月～令4年12月														なし	なし	なし	
			広義流動性平残				昭55年1月～令4年12月	昭55年1月～令4年12月														あり	あり	なし	
日本銀行	25	マネタリーベース	マネタリーベース平残準備率調整後、マネタリーベース平残準備率調整前	X-12-ARIMA	2	直接調整	昭45年1月～令4年12月	昭45年1月～令4年12月	年1回	直近12月までのデータが揃った時点	全データについて遡及改定を行う。なお、先行き1年分については、季節要素の予測値を用いて季節調整済値を計算。	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。	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。事象や系列の性質に応じて、レベルシフト、ランプ、曜日調整変数等を設定する。	○	毎年の外れ値・ARIMAモデルの決定手順は下記1～5のとおり。 1.原計数の動きと制度変更等からランプやレベルシフト等の暫定外れ値の候補を洗い出す。洗い出した暫定外れ値候補の設定を前提としてX-12-ARIMAのautomdlコマンドによる自動選択機能から決定される暫定ARIMAモデルを利用し、暫定外れ値の有意性(t値)を確認し設定する外れ値を確定する。 2.過去のモデルや1.の暫定ARIMAモデルを参考に階差、AR、MA項の範囲を決定し、これらの複数のモデル候補から、左記の基準に沿って各モデルの妥当性を検討する。 3.2の結果についてグラフで目視確認を行うとともに、最終的なARIMAモデル及び外れ値を決定する。 4.決定されたARIMAモデルを用いてoutlierコマンドにより自動検出した外れ値について、有意性(t値)などを確認したうえで確定する。 5.決定した外れ値やARIMAモデル等をまとめ、日本銀行のホームページに掲載する ・マネタリーベース 見直し等のお知らせ [https://www.boj.or.jp/statistics/boj/other/mb/index.htm] ※外れ値の設定等の情報は令和6年2月2日に更新済み	×	年1回	直近12月までのデータが揃った時点	なし	あり	あり	あり	あり	あり	なし
			民間非金融法人企業部門の資金過不足、家計部門の資金過不足、一般政府部門の資金過不足、海外部門の資金過不足(参考系列として提供)				X-12-ARIMA	4													直接調整	平17年Q2～令3年Q4	平17年Q2～令3年Q4	原則年1回	遡及改定時

(総務省 政策統括官室「季節調整法の適用状況」をベースに各府省等に照会した結果を取りまとめたもの。)

https://www.soumu.go.jp/toukei_toukatsu/index/seido/kijun3.htm