

建設工事受注動態統計調査（大手 50 社調査）の季節調整法の変更について

1 季節調整法の変更

これまで、建設工事受注動態統計調査（大手 50 社調査）は、米国センサス局法 X-11 により季節調整値を算出してきた。しかし、本統計は一時的要因による単月の動きが大きく、X-11 では新規データを追加すると直近部分の季節調整済み系列が大幅に改訂されてしまうという課題があった。したがって、今後は X-11 の改良版である X-12-ARIMA に変更することとした。

なお、変更により、東日本大震災の復旧に係る特殊工事を含む任意の月を異常値として処理することも可能となった。

2 モデルの選定方法

まず (0 1 1)(0 1 1)の ARIMA モデルを用いて、X-12-ARIMA の OUTLIER コマンドにより、異常値（レベルシフトを含む。）を探索する。そして、検出された異常値を回帰変数として加えた上で、AUTOMDL 機能を用いて、最適な ARIMA モデルを選ぶ。その際、曜日・うるう年調整変数の組み合わせを考慮した 20 通りのモデルの中から、AIC 基準により選ぶ。回帰変数の有意性を満たしたケースのそれぞれについて AIC を計算し、AIC が最小となったケースを最終的に選ぶ。

3 季節調整を施す体系

昭和 60 年 4 月以降の全期間を対象とし、遡及修正を行う。

（当該統計調査は、正式に公表を開始したのは昭和 60 年 4 月からであるが、それ以前にも同じ調査客体により同様の調査を実施してきたため、季節調整値のみ昭和 59 年 4 月値より公表していた。今回の X-12-ARIMA への変更に伴い、季節調整値の対象も昭和 60 年 4 月からとする。）

なお、季節調整値の改定は、これまでどおり、毎年 12 月実績の公表時に行うものとする。