

建築着工統計の季節調整替えについて

建築着工統計における季節調整値については、米国商務省で開発されたセンサス局法 X-12-ARIMA により作成されていますが、より適切に調整を行うため、以下の通り改定致しました。

1. 原数値と同様、季節調整値において、内訳合計が総計と一致するように変更しました。
2. 推計上季節性がみられない場合は、原数値を季節調整値として用いるように変更しました。
3. 異常値については、(011) (011) の ARIMA モデルにおいて、X-12-ARIMA の OUTLIER コマンドを用いて、A0・TC・LS から自動設定。
4. モデル選択について、従来は ARIMA モデルが (010) (010) ~ (212) (212) の 81 種類の内、AIC が最小となるモデルを選択していた方法から、X-12-ARIMA の AUTOMDL コマンドを使用して選択されたモデルを使用するように変更しました。
5. モデル選択の際に曜日調整等の有無について検討を行い、有意かつ AIC が最小となる組み合わせを使用するよう変更しました。検討する曜日調整等は以下の通りです。
 - 標準曜日型調整 (TDNOLPYEAR)、2 曜日型調整 (TD1NOLPYEAR)、うるう年調整 (LPYEAR)、日本型休日 (慣例休日除く) (HOL_a)、日本型休日 (慣例休日含む) (HOL_b)
6. 推計期間は、1990 年 1 月～、予測期間は + 1 年としております。
なお、1989 年 12 月以前の季節調整値については、現在公表されている季節調整値を用いることとしております。

以上