

E V I E W S 演習 (X12-ARIMA)

2002 年 2 月 山澤成康

Seasonal adjustment

X11 Method

普通の系列は乗法形 (Multiplicative)、在庫などマイナスのあるデータは加法形 (Additive)。

Seasonal Filter

季節成分を取り出すためのフィルター。Auto で問題ない。

Trend Filter (Henderson)

系列に移動平均をかけてトレンドを作る方法。Auto で問題ない。

Component Series to Save

季節調整値を取り出すときは、Final Seasonally Adjusted Series を選ぶ。

X12 Options

Trading Day/Holiday Outliers Diagnostics

Seasonal Adjustment ARIMA Options

X11 Method

- Multiplicative
- Additive
- Pseudo-additive
- Log-additive

Seasonal Filter

Auto (X12 default)

Trend Filter (Henderson)

- Auto (X12 default)
- Fixed

13 term moving-average

Component Series to Save

Base name: cpi

- Final seasonally adjusted series (_SA)
- Final seasonal factors (_SF)
- Final trend-cycle (_TC)
- Final irregular component (_IR)
- Combined seasonal/trading day factors (_D16)
- Combined holiday/trading day factors (_D18)

OK キャンセル

Trading day/Holiday

1ヶ月(1四半期)のなかでの曜日数の違いやうるう年の変動を調整する。

Adjustment Options

ARIMA モデルを使って予測した数値を季節調整に使う場合は、Adjust in ARIMA step を選ぶ。

Trading Day Effects

- No trading day effects 営業日調整をしない
- Flow day-of-week/leap year effects フローデータで曜日調整とうるう年調整をする
- Flow weekday-weekend/leap year effects フローデータで週末調整とうるう年調整をする
- Stock day-of-week スtockデータで、曜日調整する

Holidays は米国特有のものなので、使う必要なし。

The screenshot shows the 'X12 Options' dialog box with the 'Trading Day/Holiday' tab selected. The 'Adjustment Options' section has three radio buttons: 'None', 'Adjust in ARIMA step' (selected), and 'Adjust in X11 step'. There is a checked checkbox for 'Apply only if significant (AIC)'. The 'Trading Day Effects' section has four radio buttons: 'No trading day effects' (selected), 'Flow day-of-week/leap year effects', 'Flow weekday-weekend/leap year effects', and 'Stock day-of-week: 1 day of month observed'. The 'Holidays (Flow)' section has four checkboxes, all unchecked: 'Easter 8 days before', 'Labor day 8 days before', 'Thanksgiving/Christmas 8 days before', and 'Statistics Canada Easter 8 days before'. At the bottom are 'OK' and 'キャンセル' buttons.

ARIMA Options

Data Transformation

ARIMA モデルで推計するとき、対数などにするかどうか。マイナスのデータがあると対数では推計できない。

ARIMA Spec

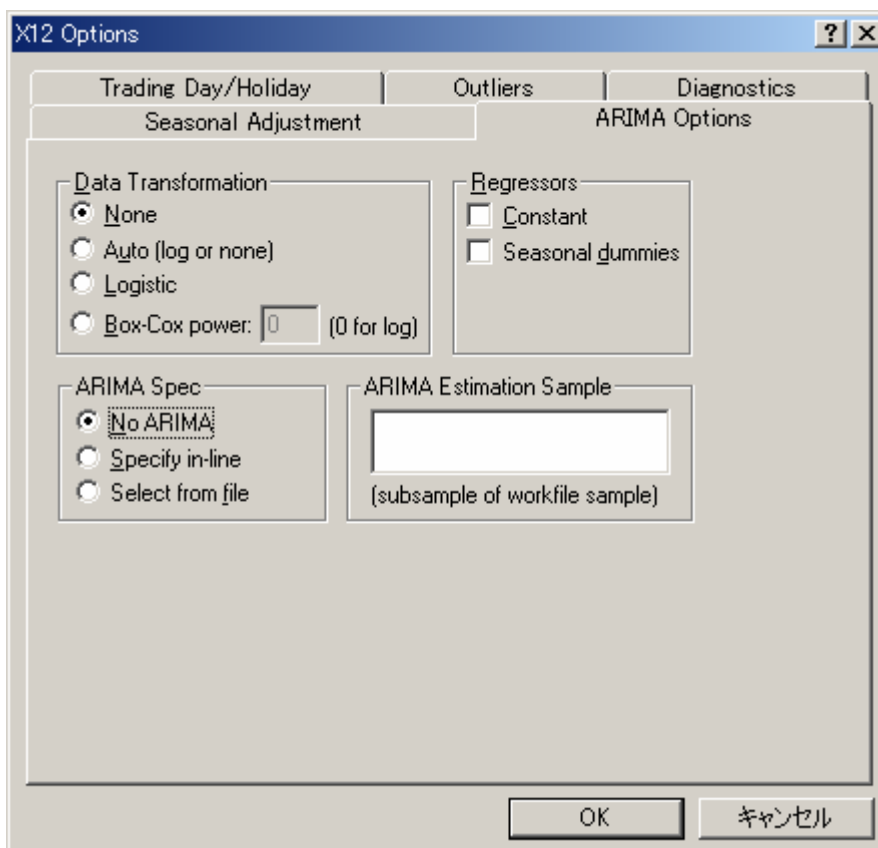
No ARIMA

Specify 特定の次数を指定する

(1,1,1)(1,0,1)

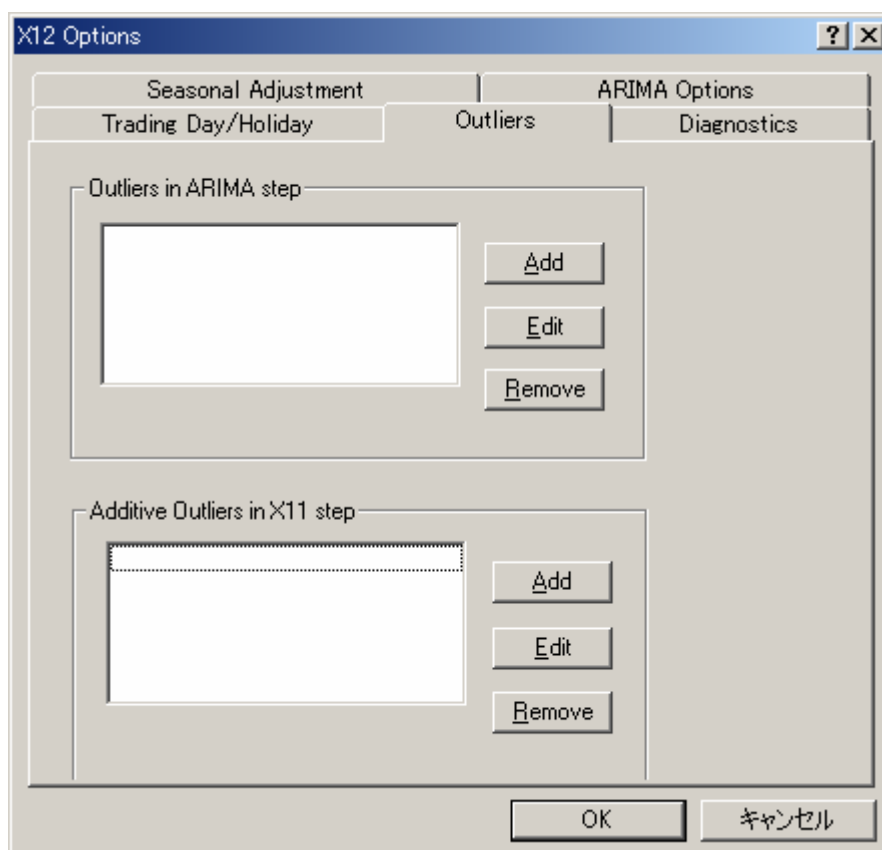
最初のカッコ内が、変数のARIMAモデルの次数、次のカッコ内は季節指数のARIMAモデルの次数

Select from file 次数候補のファイルの中から選ぶ



Outliers

系列の中の異常値などを取り除く。



Diagnos tics

季節調整した結果を診断する。

