

別紙(1)

X-12-ARIMAのスペックファイル等について(対事業所サービス業種)

The Spec files, etc. adopted in the seasonal adjustment of the Current Survey of Selected Service Industries using the X-12-ARIMA method

(1)手法(Method)

特定サービス産業動態統計における季節調整済指数系列は、季節要因に加え、曜日・祝祭日要因によっても調整されている。

具体的には以下のとおり。

$$\text{季節調整済指数} = \text{原指数} \div (\text{季節指数} \times \text{曜日・祝祭日指数})$$

Not only seasonal but also ‘trading-day and holiday’ effects are adjusted as follows.

$$\text{Seasonally adjusted index} = \text{Original Index} \div (\text{Seasonal index} \times \text{‘Trading-day and holiday’ indices})$$

(2)スペックファイル(Spec File)

使用しているスペックファイルの見本は以下のとおり。なお、レベルシフト、異常値処理などの該当はない。

The spec files of X-12-ARIMA for seasonal adjustment are as follows. Adjustment of level-shifts and additive outliers is not adopted.

```
series{ start=2004.jan
        span=(2004.1,2010.12)
        decimals=1
        print=none}
transform{ function = log }
arima { model=(0 1 1)(0 1 1) }
regression{ variables=td1coef
            save = (td hol)
            user = (jap-hol)
            usertype=holiday
            start=2004.1
            file="XXXXXXXXXXXXXXXXX" }
forecast{ maxlead=0 }
estimate{ save = ( mdl )
          maxiter = 500 }
x11{ print = (none + d10)
     save = (d10 d11 d16)
     Seasonalma = x11default }
```

(3)季節指数等の運用 (Employment of seasonal index and ‘trading-day and holiday’ indices)

平成23年1月以降の季節指数は、暫定季節調整方式を採用している。具体的には、平成22年の季節指数を適用している。

これに対し、曜日・祝祭日指数は、暫定方式を採らず、上記(2)で推計されたパラメータとカレンダーから計算して利用している。

The method of temporary seasonal adjustment is adopted for the seasonal index after January, 2011. Concretely to say, the monthly seasonal index in 2010 is adopted as those in 2011. As for ‘trading-day and holiday’ indices, this method is not adopted, and ‘trading-day and holiday’ indices are calculated from estimated parameters in (2) and calendar.

別紙(2)

X-12-ARIMAのスペックファイル等について(対個人サービス業種)

The Spec files, etc. adopted in the seasonal adjustment of the Current Survey of Selected Service Industries using the X-12-ARIMA method

(1)手法(Method)

特定サービス産業動態統計における季節調整済指数系列は、季節要因に加え、曜日・祝祭日要因によっても調整されている。

具体的には以下のとおり。

$$\text{季節調整済指数} = \text{原指数} \div (\text{季節指数} \times \text{曜日・祝祭日指数})$$

Not only seasonal but also ‘trading-day and holiday’ effects are adjusted as follows.

$$\text{Seasonally adjusted index} = \text{Original Index} \div (\text{Seasonal index} \times \text{‘Trading-day and holiday’ indices})$$

(2)スペックファイル(Spec File)

使用しているスペックファイルの見本は以下のとおり。なお、レベルシフト、異常値処理などの該当はない。

The spec files of X-12-ARIMA for seasonal adjustment are as follows. Adjustment of level-shifts and additive outliers is not adopted.

```
series{ start=2004.jan
        span=(2004.1,2010.12)
        decimals=1
        print=none}
transform{ function = log }
arima { model=(0 1 1)(0 1 1) }
regression{variables=td1coef
            save = (td hol)
            user = (jap-hol)
            usertype=holiday
            start=2004.1
            file="XXXXXXXXXXXXXXXXX" }
forecast{ maxlead=0 }
estimate{ save = ( mdl )
          maxiter = 500 }
x11{ print = (none + d10)
     save = (d10 d11 d16)
     Seasonalma = x11default }
```

(3)季節指数等の運用 (Employment of seasonal index and ‘trading-day and holiday’ indices)

平成23年1月以降の季節指数は、暫定季節調整方式を採用している。具体的には、平成22年の季節指数を適用している。

これに対し、曜日・祝祭日指数は、暫定方式を採らず、上記(2)で推計されたパラメータとカレンダーから計算して利用している。

The method of temporary seasonal adjustment is adopted for the seasonal index after January, 2011. Concretely to say, the monthly seasonal index in 2010 is adopted as those in 2011. As for ‘trading-day and holiday’ indices, this method is not adopted, and ‘trading-day and holiday’ indices are calculated from estimated parameters in (2) and calendar.