

「特集 季節調整法」について

統計数理研究所 石 黒 真 木 夫

(1997 年 10 月 受付)

季節調整法はもともと経済時系列解析の方法の名称である。『統計情報』（全国統計協会連合会）1997 年 9 月号の「季節調整法に関する検討について」という記事の最初の部分で、“季節調整とは、月次又は四半期単位の経済時系列の……季節変動を元の系列から除去した季節調整済系列を推計する手続きをいう”とかなり限定した意味のことばとされている。この問題が統計的時系列解析の対象としてとりあげられて以来解析方法が大いに発展し、今では、一般的な非定常時系列データを扱う研究分野が成立している。この研究分野のなかで特に、同じような動きの繰り返し（季節性）を含むデータの解析に関係するものを対象として、この特集を組んだ。本来の季節調整の問題はその文脈のなかでの重要な問題と位置付けられる。

この特集の論文を分類すると表のようになる。分類の境目に置きたいものもあるが、第一近似としてはこんなものだろう。

分 類	著 者	標 題
本来の季節調整の問題を扱ったもの	藤原	景気観測における季節変動調整法
	木村 I	季節調整に関する実務的諸問題
	国友	[木村 I] へのコメント
	尾崎 III	[木村 I] へのコメント
	川崎	[木村 I] へのコメント
	木村 II	回答
	北川	季節調整プログラム DECOMP とその後の展開
	佐藤	Web Decomp の紹介 —WWW 上で行う季節調整システム—
	川崎・佐藤	季節調整の「最適性」について
	尾崎 I	動的 X11 モデルと非線形季節調整 I —モデルと計算法—
	尾崎 II	動的 X11 モデルと非線形季節調整 II —解析例と考察—
加藤・石黒	多変量時系列モデルによる経済システムの動的解析	
一般的非定常時系列モデルに関するもの	樋口	非経済時系列データの季節調整法について
	柏木	状態空間接近による季節変動調整に関する一考察 —東京湾データへの適用—
	清水	喘息発作受診の季節集中性と環境諸因子の関連 —トレンド増加率の影響評価—

- 本来の季節調整に適用できる方法を紹介しているのは [北川] [佐藤] [尾崎 I] である。
- 経済データの解析例を含むのは [藤原] [木村 I] [北川] [佐藤] [尾崎 II] [加藤・石黒]、
- [川崎・佐藤] で季節調整の結果の評価法について論じられている。
- [尾崎 I・II] で X11 を近似するモデルを構成することによって情報量規準の枠組のなかでの

X11法の評価が試みられている。

- [樋口] [柏木] は自然科学データの「季節調整法」を論じたものである。
- [清水] は喘息発作件数の季節変動と大気汚染濃度の季節変動のあいだに見出された関係の報告である。
- [木村 I] はその中で統計的モデルあてはめによる季節調整法とそうでない方法を比較し、著者の観点からすると、後者による結果の方が前者より良いと結論している。統計的モデルあてはめがさまざまな分野で実用化されてきたことと比べて大変気になるので、何人かの方に討論を依頼した。[国友] [尾崎 III] [川崎] [木村 II] の討論では、木村が採用した観定の妥当性が議論の中心になった。「Cという観点からは、AよりBが良い」対「BよりAが良い」というレベルの論争でなく、「Cという観定で優劣を判定すべきである」対「Dという観定で優劣を判定すべきである」というレベルの論争になっている。

幾つかの論文で言及されている BAYSEA の関係者としては、BAYSEA そのものを正面から取り上げた論文を含めるべきだったかもしれないが、最近季節調整から多少離れていて独立したものを書くだけの材料を持っていなかった。諒とせられよ。