

経済統計 練習問題

第21回 時系列データの分解(2)

2006年12月12日

問 次の(あ)～(き)の文章について、正しければ○ 間違っていれば× を解答欄に記入せよ。

- (あ) 年次データの対前期比を考える場合、季節変動の影響によって誤った判断をすることがある。
- (い) 四半期データは季節性を持つので、前年同期比を考えることが多い。ある年の値が平年と異なった値である場合、2つの前年同期比の値がゆがめられることになる。
- (う) 古典的時系列分析において、原系列は観測可能なトレンド、サイクルと観測不可能な季節変動、不規則変動が組み合わさったものであると考える。
- (え) 時系列データの成分のうち不規則変動とは、景気循環などによる周期的な上昇・下降のことである。
- (お) 季節調整値とは、原系列から季節変動の部分のみをとり除いたものである。
- (か) トレンドの抽出において、トレンドに特定の形を想定した場合、将来の予測値を簡単に求められるが、関数形の決定に分析者の判断が必要となってしまう。
- (き) 移動平均法には、元の系列の変動をなめらかにする役割があり、トレンドや季節変動の抽出などに用いられている。しかし、末端のデータが欠損してしまうという問題も含んでいる。

解答欄

(あ)	(い)	(う)	(え)	(お)	(か)	(き)