

経済データ解析 実習課題

－ 時系列データの季節調整 －

河田 正樹

2009 年 12 月 7 日

実習課題 以前にダウンロードした gdp2 のファイルについて、演習問題 2 と同様に、季節調整をおこない、グラフに表せ。

手順

1. 1995 年以前のデータ (2 行目から 65 行目まで) を削除する。(データの期間が非常に長期にわたるため)
2. G 列に前年同期比を求め、グラフを描く。
3. C 列、D 列、E 列に 4 項移動平均、中心化系列を求め、SI を求める。
やり方は d-store の作成に用いた実習資料を参考にすること。
4. SI を各期ごとに並べ、平均をとり、季節変動を求める。
このとき、SI は 1996 年から 2002 年までと、2003 年以降に分ける。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I
58		1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	
59	I								
60	II								
61	III								
62	IV								
63									
64		2003	2004	2005	2006	2007	2008	平均	季節変動
65	I								
66	II								
67	III								
68	IV								

2 行にわたるデータの算術平均は、データを , (カンマ) で区切ることによって求めることができる。
(上のような例で、第 I 期の平均は =average(B59:H59 , B65:G65) とすればよい。)

5. F 列に季節調整値を求め、グラフに加える。
6. タイトル、学籍番号、氏名などを記入し、適当に罫線を引き印刷する。
このとき、印刷結果が 2 ページ に収まるようにする。
必要に応じてフォントを変えたり、印刷の余白を変えたりすること。