

## 日本の祝日を使って季節調整する

EViews の季節調整で日本のカレンダーを利用する場合、どのようにすればよいでしょうか?というご質問をいただくことが多々あります。EViews の操作に慣れた方で、時系列分析を勉強したことのある方なら、山澤成康教授(跡見学園女子大学マネジメント研究科)の「実戦 計量経済学入門」(日本評論社)と、それに連動した形で提供されている山澤先生のウェブサイト<sup>1</sup>の資料を見れば、恐らくご理解いただけるものと思います。

ただ、「見よう見まね」でやってみたものの、本当にいいのか確認できないので不安だ!というケースがあるかもしれません。そこで、ごく簡単にポイントを絞ってQAを作ってみました。説明文の中にある(p.\*\*\*)は山澤先生のウェブサイトにある第13章の説明PDFファイルのページ番号です。

### Q. スペックファイルはどこにあるの?

日本の祝日を反映させるためにはスペックファイルを使って、コマンドウィンドウから直接、x12の実行コマンドを入力します(p.13)。ワークファイルの中にseries オブジェクト exvi があるものとして、次のコマンドを実行します。

```
exvi.x12(sfile=m:\eviews\jphol.txt)
```

jphol.txt がスペックファイルです。

例えば、鉱工業生産指数の原系列が iip というシリーズオブジェクトに入っている場合は、

```
iip.x12(sfile=m:\eviews\jphol.txt)
```

.x12 が季節調整の実行コマンドです。c ドライブの eviews フォルダにスペックファイルがある場合は m を c とします。

肝心の jphol.txt について説明しましょう。例えば、iip を用意して EViews で普通に x12 を実行します。結果のウィンドウを少しだけ下のほうにスクロールすると、次のような箇所があります。

```
IIP PAGE 1, SERIES IIP
Contents of spc file C:\USERS\KOH\APPDATA\EV_TEMP\EVX12TMP.spc
Line #
```

ここにある EVX12TMP.spc がスペックファイルです。これを複製して、p13 の指示に従ってスペックファイルを作りましょう。

<sup>1</sup><http://www2.mmc.atomi.ac.jp/web13/index.shtml>

続きはメンバーサイトの  
フォーラムにて!