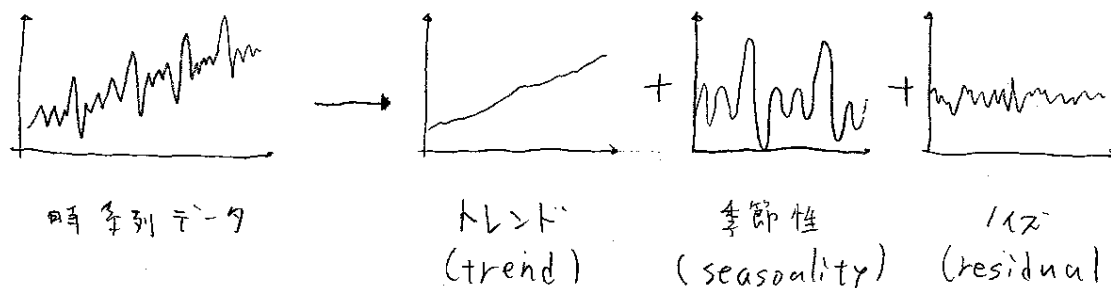


時系列データの分解

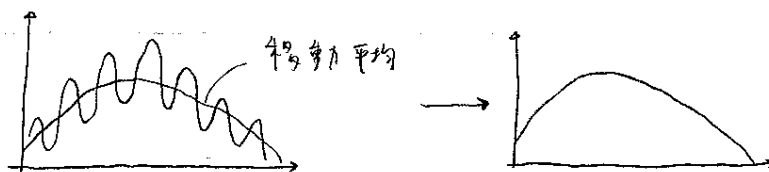


アルゴリズム

時点 t での時系列データ y_t を TC = 傾向変動, S = 季節変動, I = 不規則変動に分解する.

$$y_t = TC_t + S_t + I_t$$

- ① 移動平均をとり傾向変動 TC を求める (1月~12月)



→ 季節変動を無視する

- ② y_t から TC を引く

$$A_t = y_t - TC_t = S_t + I_t$$

(季節変動と不規則変動のみを抽出)

- ③ 月別平均をとり A_t から S_t を引く
→ 季節変動 S のみを取りだせる.

$$S_t = A_t - (A \text{ の月別平均})$$

- ④ 不規則変動を計算する.

$$I_t = y_t - TC_t - S_t$$