

「移動平均」について

日本銀行等から公表される経済指標（グラフ）の中で、「移動平均値」という文言を目にすることが多いと思います。そこで、今回は移動平均の意義・目的等について簡単に取り纏めてみました。

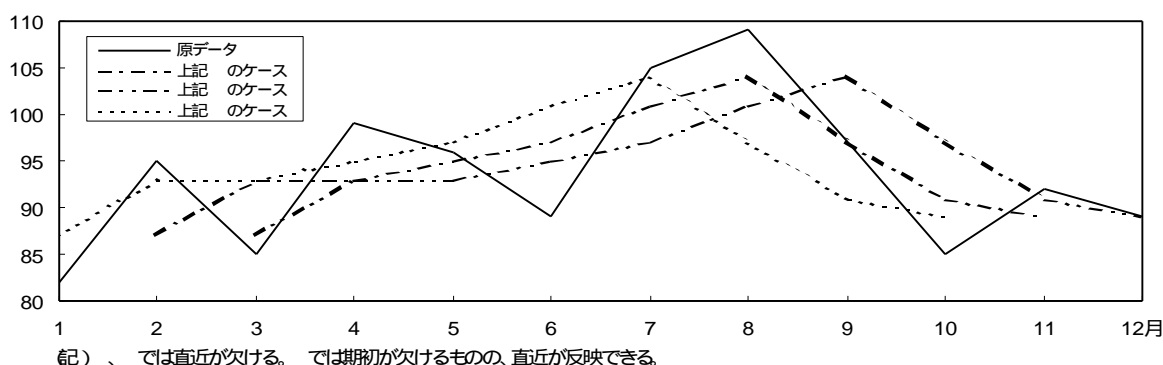
移動平均の意義・目的

時系列データを観察する際、特殊要因の発生等からデータが大きく振れ、基調的な動きが掴み難いことがあります。これを解決する一つの手段が移動平均という方法です。移動平均とは、一定の期間（例えば3か月、3四半期等）を定め、各月（期）の値をその期間中の原データの平均値とすることをいいます。例えば月次データの3か月移動平均（後述の ）では、1月の値は12月（前年）1月、2月の平均値、2月の値は1月、2月、3月の平均値、3月の値は2月、3月、4月の平均値……となります。このように加工したデータを用いることにより、不規則変動がある程度ならされ、時系列データの基調的な傾向が読み取り易くなります。

移動平均の算出事例

- 月次データをベースに3か月移動平均を用いる場合、 当該月の前後1か月のデータを平均する方法（例えば5月の平均値は4月、5月、6月の値を平均）、 当該月以前の3か月のデータを平均する方法（例えば5月の平均値は3月、4月、5月の値を平均）、 当該月以後の3か月のデータを平均する方法（例えば5月の平均値は5月、6月、7月の値を平均）、 の3通りのものがあります。

月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
原計数	82	95	85	99	96	89	105	109	97	85	92	89
	-	87	93	93	95	97	101	104	97	91	89	-
	-	-	87	93	93	95	97	101	104	97	91	89
	87	93	93	95	97	101	104	97	91	89	-	-



原計数（実線）だけでは振れを伴いつつ推移している為、方向感が掴み難いところですが、これに対して、移動平均値（各波線）はこのような月々の振れを取り除いているため、方向感がより把握し易いかたちになっています。

以 上