

## 参考. データ分析の補足

211

### 分析方法

市場データの分析には、時系列データ分析の先進的な手法である状態空間モデルを用いている。状態空間モデルは、データの背景にある「状態」を仮定することにより、柔軟な分析を可能にする。

#### 状態空間モデルのイメージ

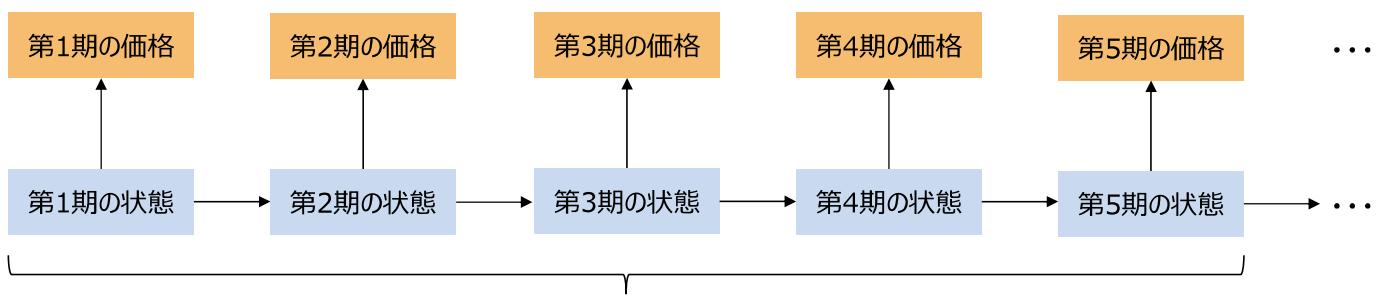
##### 【通常の時系列モデル】

過去の価格から、後の期の価格を説明するモデル



##### 【状態空間モデル】

価格の背景に状態を仮定して、推定した状態から価格を説明するモデル

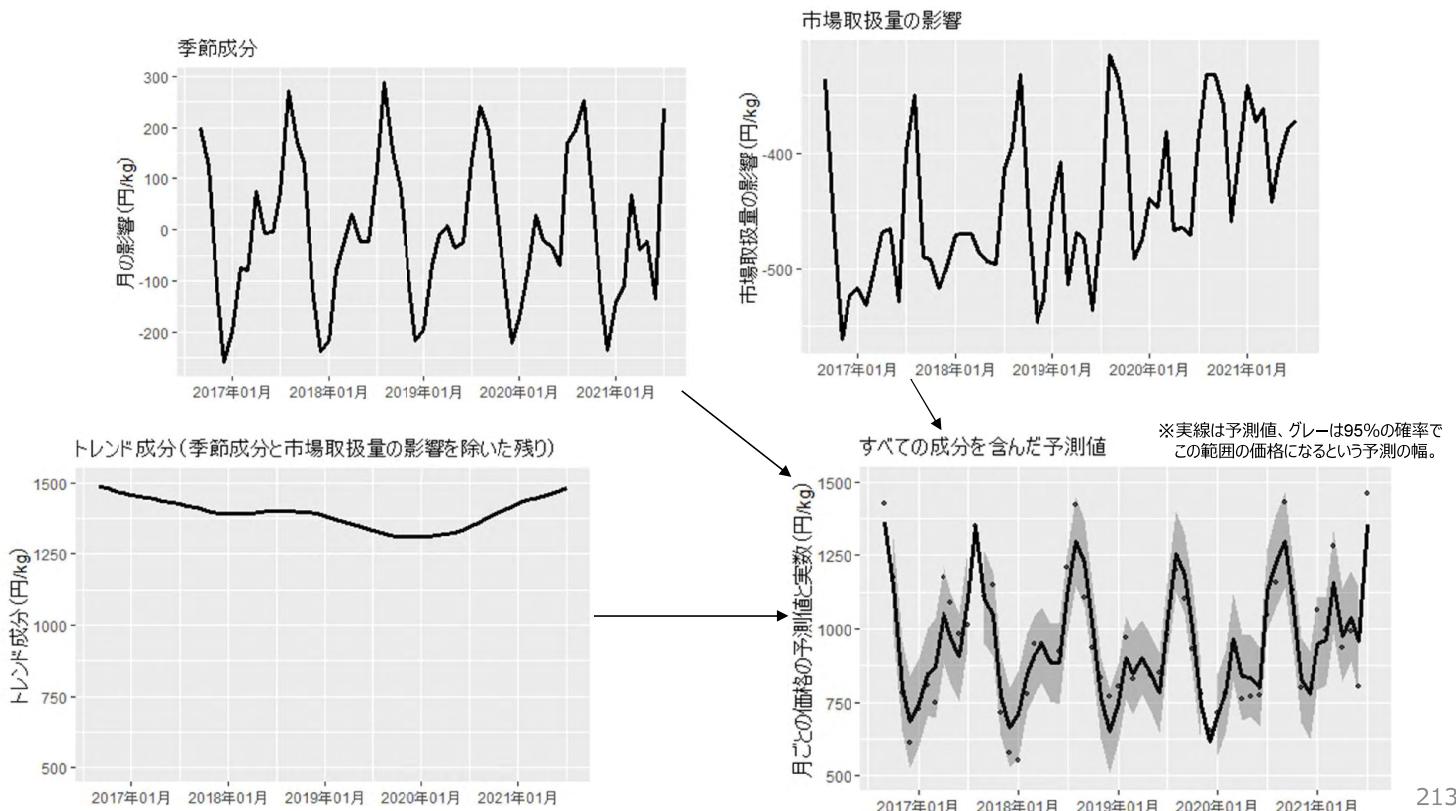


状態を構成する要素として、季節性や市場取扱量の影響を組み込んでいる

212

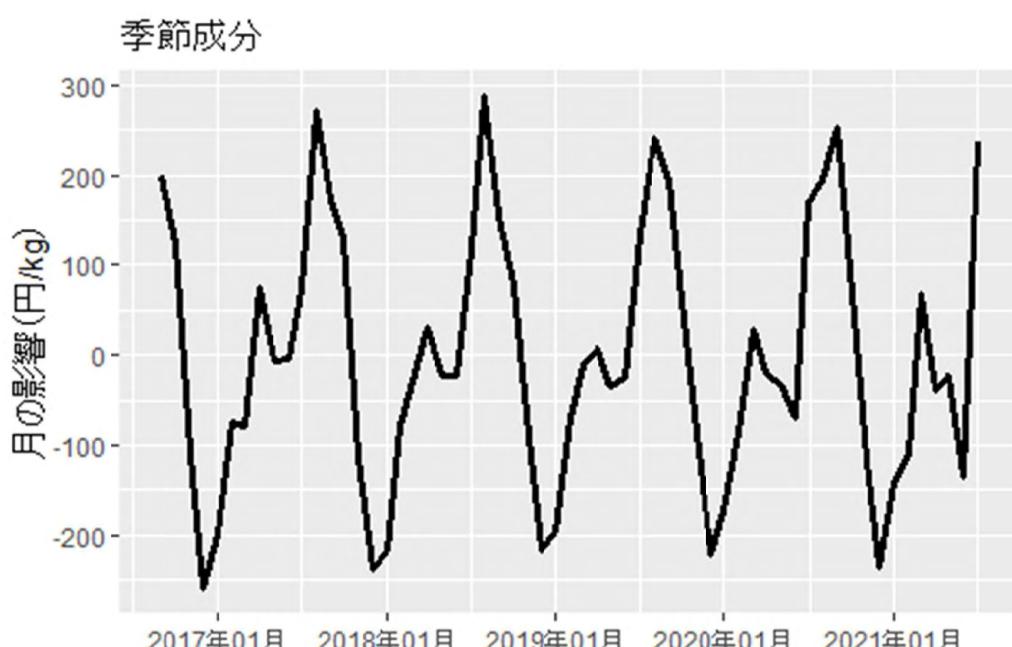
## 分析概要 成分の分解

統計分析手法を用いて、福島県産品の価格を「季節成分」「市場取扱量の影響」「トレンド成分」の3種類に分解している。この3種類の値を合計することにより、価格を予測することができる。



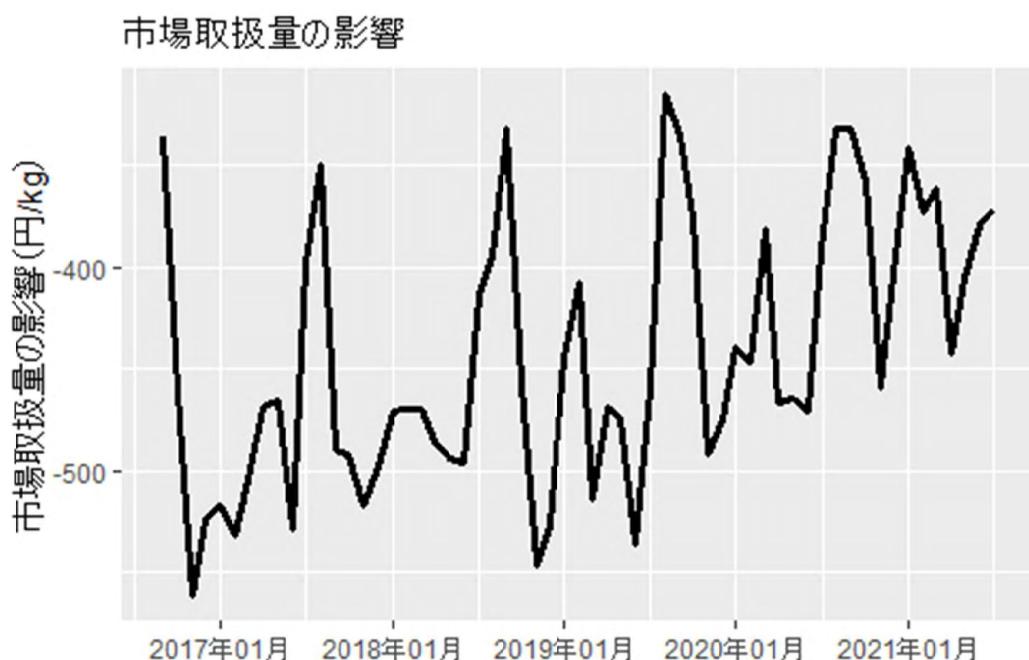
## 各成分についての補足 季節成分

季節成分は、いわゆる季節性のことである。本分析では、毎年季節の影響がわずかに変動するというモデルを用いている。予測では、各月の季節性についての平均的な値を用いている。



## 各成分についての補足 市場取扱量の影響

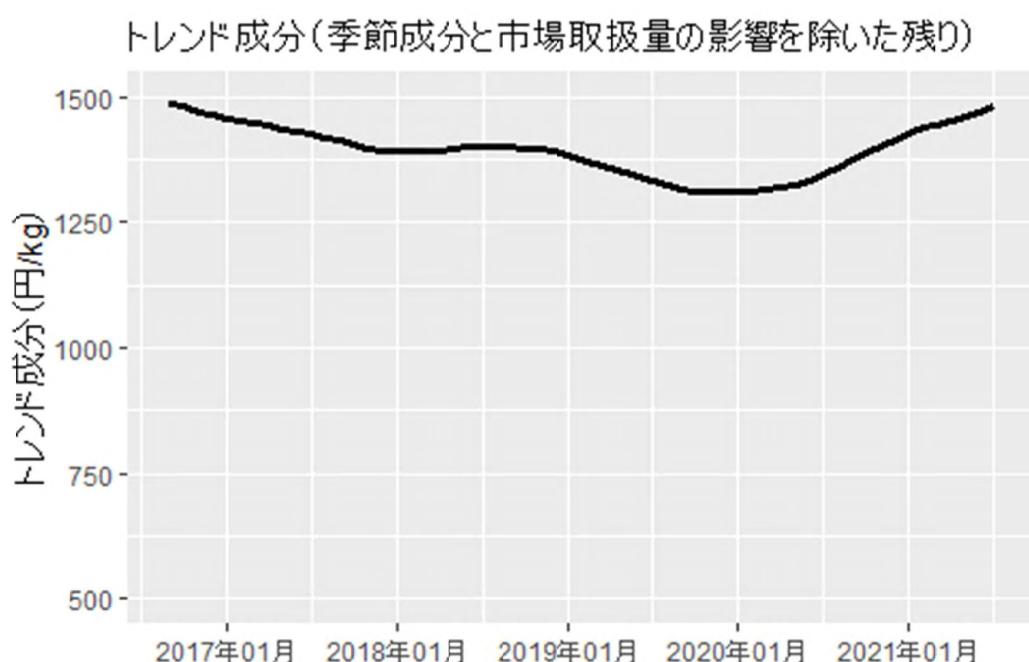
市場取扱量の影響は、「卸売市場の取扱量がごくわずかであった時と比べて、その月の取扱量でどの程度低い価格となるか」を表している。この影響の大きさから、市場取扱量と価格の関係性のグラフが作られている。



215

## 各成分についての補足 トレンド成分

トレンド成分は、季節成分と市場取扱量の影響を除いた、残りの部分である。ここには景況や消費状況、気候など諸々が含まれている。予測においては、分析期間中の平均値を用いている。



216