

## 「景気ウォッチャー調査」における季節調整方法の一部改定について<sup>1</sup>

平成 28 年 11 月 9 日  
内閣府政策統括官（経済財政分析担当）

### 1 はじめに

「景気ウォッチャー調査」においては、平成 28 年 1 月より、家計動向関連、企業動向関連、雇用関連の 3 分野を加重平均することで総合 D I の季節調整値を得る方法に変更したが、今般、公表内容の充実を図ることを目的として、家計動向関連及び企業関連動向の D I についても、それぞれの内訳である、小売関連、飲食関連、サービス関連、住宅関連、及び製造業並びに非製造業の D I に季節調整を実施し、加重平均化することにする。

また、地域別の総合 D I についても、季節調整値を掲載することにする<sup>2</sup>。

### 2 算出方法の変更に伴う指数の改定について

#### (1) 家計動向関連の 4 分野による合成

家計動向関連 D I は、小売関連、飲食関連、サービス関連、そして住宅関連の 4 分野によって合成することに変更する。これら 4 分野を比較すると、ピークとボトムのタイミングと規模感に違いがある（図表 1 - 1）。直近 10 年でピークはそれぞれ 4 月、4 月、3 月、3 月、ボトムはそれぞれ 11・12 月、1 月、1 月、11 月となっている。したがって、分野分けには一定の妥当性があると考えられる。

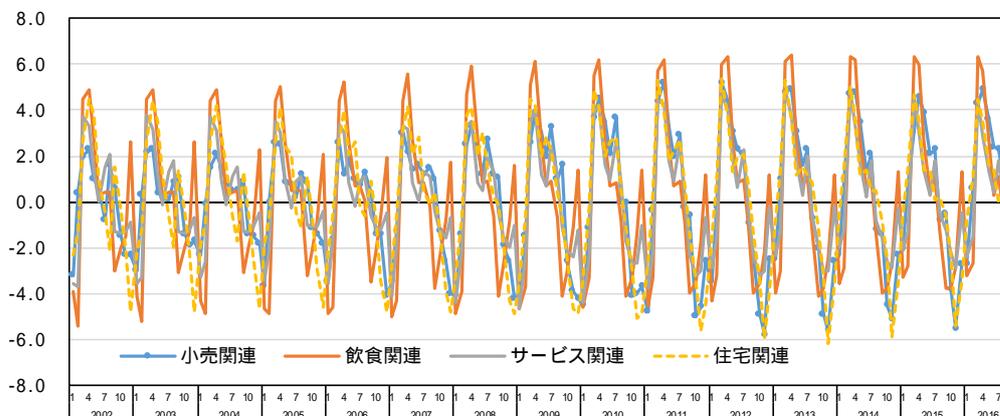
---

<sup>1</sup> 2016 年 9 月調査までの結果を用いた分析。

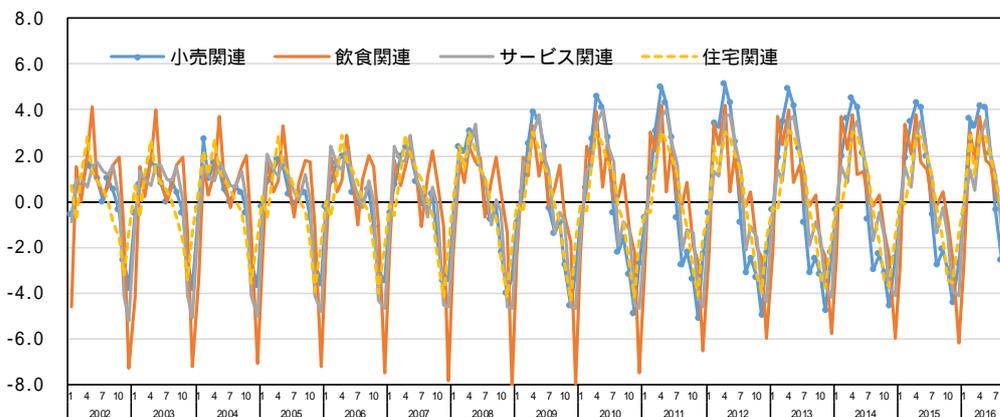
<sup>2</sup> 地域別総合 D I のスペックファイル及び季節性の検討は、内閣府政策統括官（経済財政分析担当）（2016）「地域の経済 2015」補論 2 を参照（<http://www5.cao.go.jp/j-j/cr/cr15/chr150800.html>）。なお、新規に追加される「東北（新潟除く）」、「北関東（山梨・長野除く）」、「甲信越」及び「東京都」、各地域の現状水準判断については、本稿にて掲載。地域区分の変更の詳細は、「景気ウォッチャー調査の地域区分の変更について（平成 28 年 10 月調査）」（[http://www5.cao.go.jp/keizai3/watcher/watcher\\_kousinetsu20161011.pdf](http://www5.cao.go.jp/keizai3/watcher/watcher_kousinetsu20161011.pdf)）を参照。

図表 1 - 1 : 家計動向関連の4分野別季節変動

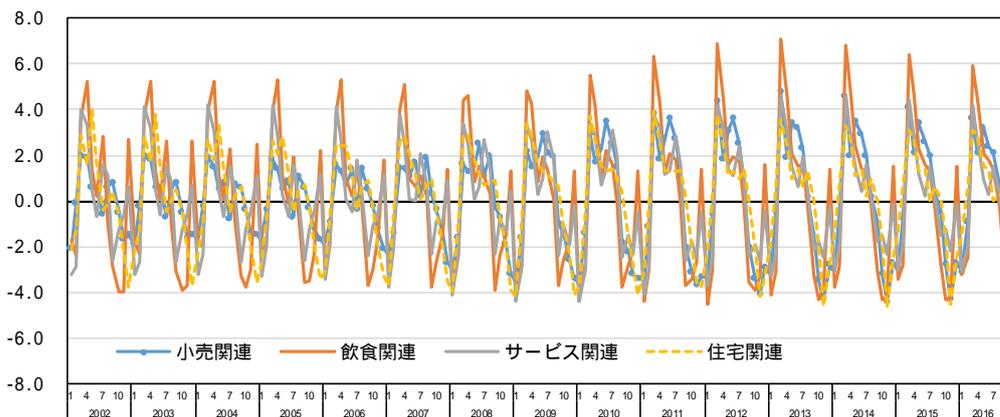
現状判断



先行き判断



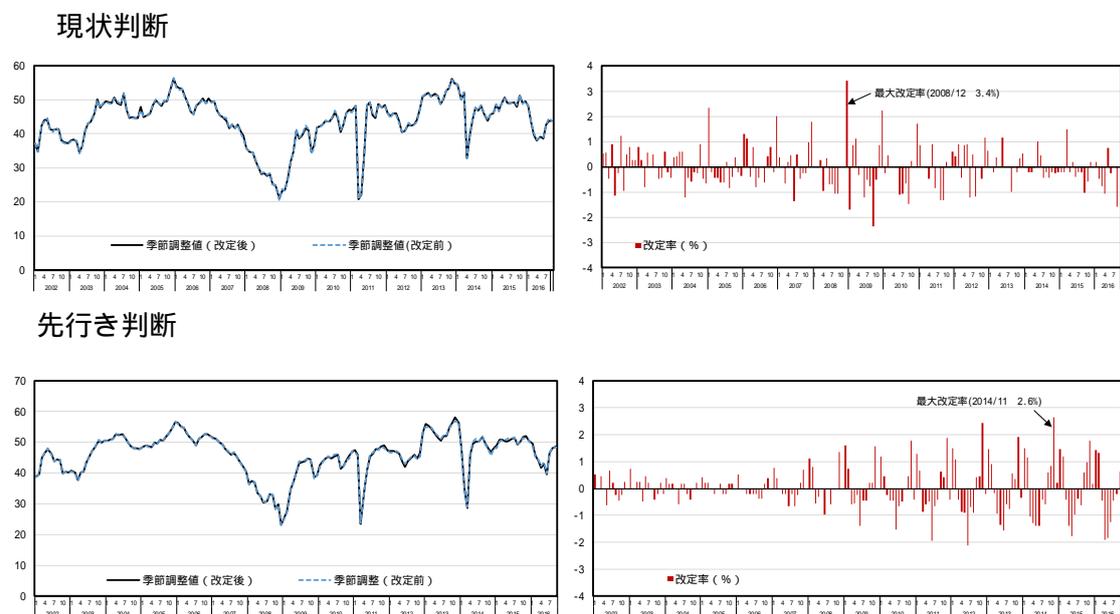
現状水準判断



こうした4分野による合成で作成された家計動向関連DIと現在の家計動向関連DIを比較すると、2002年以降、現状判断で月次のかい離率は平均-0.01%、最大3.43%、分散0.63%、先行き判断で月次のかい離率は平均0.01%、最大2.64%、分散0.68%となった(図表1-2)。指数としては、現状判断では、4

分野合成の分散が 52.93、現在の D I は 52.94、先行き判断では 4 分野合成の分散が 45.54、現在の D I は 45.35 となっている。

図表 1 - 2 : 家計動向関連 D I の新旧比較



また、前月差の異同を比べると、現状判断 D I は 7 回、先行き判断 D I は 10 回の違いが生じる（図表 1 - 3）。現状判断、先行き判断それぞれ連続した符号の逆転が 1 回ずつ生じている。

図表 1 - 3 : 家計動向関連の新旧 D I の符号判定

現状判断

符号判定	符号判定														
200201		200401		200601		200801		201001		201201		201401		201601	
200202		200402		200602		200802		201002		201202		201402		201602	
200203		200403		200603	■	200803		201003		201203		201403		201603	
200204		200404		200604		200804		201004		201204		201404		201604	
200205		200405		200605		200805		201005		201205		201405		201605	
200206		200406		200606		200806		201006		201206		201406		201606	
200207		200407		200607		200807		201007		201207	■	201407		201607	
200208		200408		200608		200808		201008		201208		201408		201608	
200209		200409		200609		200809		201009		201209		201409		201609	■
200210		200410	■	200610		200810		201010		201210		201410			
200211		200411	■	200611		200811		201011		201211		201411			
200212		200412		200612		200812		201012		201212		201412			
200301		200501		200701		200901		201101		201301		201501			
200302		200502		200702		200902	■	201102		201302		201502			
200303		200503		200703		200903		201103		201303		201503			
200304		200504		200704		200904		201104		201304		201504			
200305		200505		200705		200905		201105		201305		201505			
200306		200506		200706		200906		201106		201306		201506			
200307		200507		200707		200907		201107		201307		201507			
200308		200508		200708		200908		201108		201308		201508			
200309		200509		200709		200909		201109		201309		201509			
200310		200510	■	200710		200910		201110		201310		201510			
200311		200511		200711		200911		201111		201311		201511			
200312		200512		200712		200912		201112		201312		201512			

## 先行き判断

符号判定	符号判定	符号判定							
200201	200401	200601	200801	201001	201201	201401	201601		
200202	200402	200602	200802	201002	201202	201402	201602		
200203	200403	200603	200803	201003	201203	201403	201603		
200204	200404	200604	200804	201004	201204	201404	201604		
200205	200405	200605	200805	201005	201205	201405	201605		
200206	200406	200606	200806	201006	201206	201406	201606		
200207	200407	200607	200807	201007	201207	201407	201607		
200208	200408	200608	200808	201008	201208	201408	201608		
200209	200409	200609	200809	201009	201209	201409	201609		
200210	200410	200610	200810	201010	201210	201410			
200211	200411	200611	200811	201011	201211	201411			
200212	200412	200612	200812	201012	201212	201412			
200301	200501	200701	200901	201101	201301	201501			
200302	200502	200702	200902	201102	201302	201502			
200303	200503	200703	200903	201103	201303	201503			
200304	200504	200704	200904	201104	201304	201504			
200305	200505	200705	200905	201105	201305	201505			
200306	200506	200706	200906	201106	201306	201506			
200307	200507	200707	200907	201107	201307	201507			
200308	200508	200708	200908	201108	201308	201508			
200309	200509	200709	200909	201109	201309	201509			
200310	200510	200710	200910	201110	201310	201510			
200311	200511	200711	200911	201111	201311	201511			
200312	200512	200712	200912	201112	201312	201512			

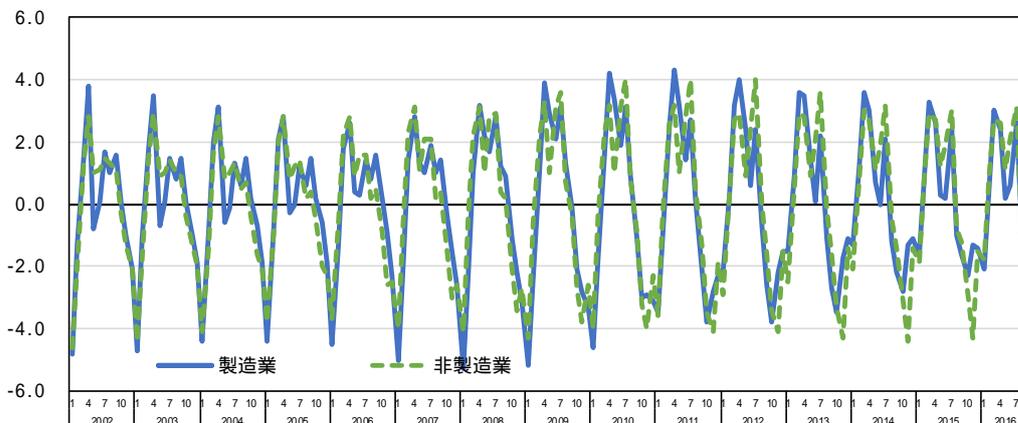
## (2) 企業動向関連の合成

企業動向関連DIは、製造業関連、非製造業関連、その他の3分野によって構成されている。このうち、その他(例えば、農林水産業)の系列はサンプルが少なく、季節性が検出されなかったため、季節調整の対象外とし、原系列のまま利用する。他2分野には季節性が観察されており、企業動向関連DIはこれら3分野による合成することに変更する。

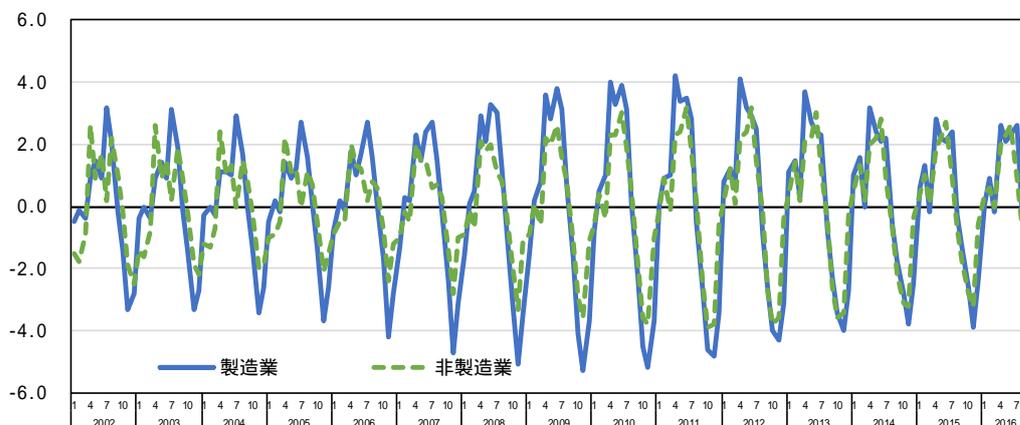
製造業と非製造業を比較すると、ピークとボトムのタイミングと規模感に違いがある(図表2-1)。ピークはそれぞれ4月、7月、ボトムは1・10月、11月となっている。したがって、分野分けには一定の妥当性があると考えられる。

図表2-1：企業動向関連の分野別季節変動

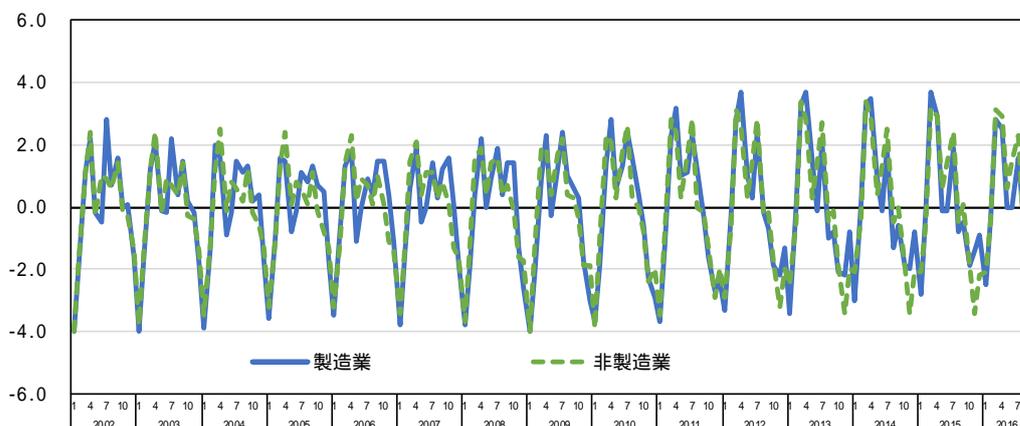
現状判断



## 先行き判断



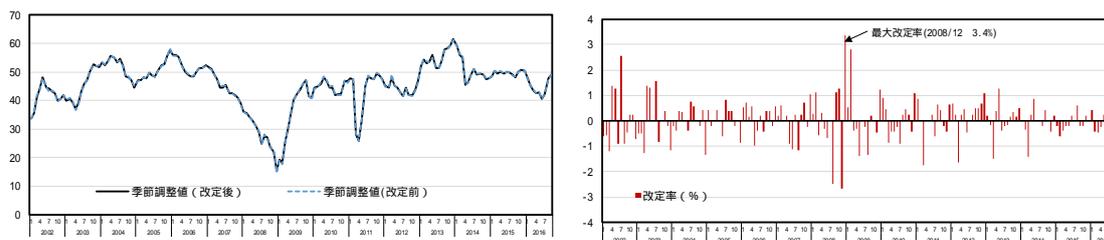
## 現状水準判断



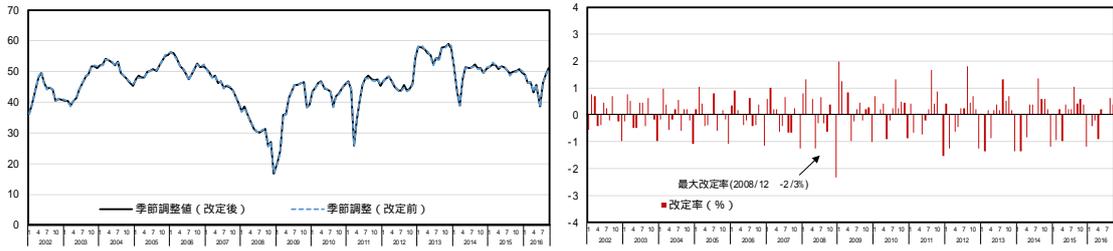
合成で作成された企業動向関連D Iと現在の企業動向関連D Iを比較すると、2002年以降、月次のかい離率は現状判断で平均0.03%、最大3.38%、分散0.63%、先行き判断で月次のかい離率は平均0.02%、最大-2.34%、分散0.47%となった（図表2-2）。指数としては、現状判断では、分野合成の分散が66.81、現在のD Iは66.73、先行き判断では、分野合成の分散が52.70、現在のD Iは52.80である。

図表2-2：企業関連動向D Iの新旧比較

### 現状判断



## 先行き判断



また、前月差の異同を比べると、現状判断DIでは4回、先行き判断DIでは2回、逆転が連続して生じる月はなかった(図表2-3)

図表2-3：企業関連動向の新旧DIの符号判定

### 現状判断

符号判定	符号判定	符号判定							
200201	200401	200601	200801	201001	201201	201401	201601		
200202	200402	200602	200802	201002	201202	201402	201602		
200203	200403	200603	200803	201003	201203	201403	201603		
200204	200404	200604	200804	201004	201204	201404	201604		
200205	200405	200605	200805	201005	201205	201405	201605		
200206	200406	200606	200806	201006	201206	201406	201606		
200207	200407	200607	200807	201007	201207	201407	201607		
200208	200408	200608	200808	201008	201208	201408	201608		
200209	200409	200609	200809	201009	201209	201409	201609		
200210	200410	200610	200810	201010	201210	201410			
200211	200411	200611	200811	201011	201211	201411			
200212	200412	200612	200812	201012	201212	201412			
200301	200501	200701	200901	201101	201301	201501			
200302	200502	200702	200902	201102	201302	201502			
200303	200503	200703	200903	201103	201303	201503			
200304	200504	200704	200904	201104	201304	201504			
200305	200505	200705	200905	201105	201305	201505			
200306	200506	200706	200906	201106	201306	201506			
200307	200507	200707	200907	201107	201307	201507			
200308	200508	200708	200908	201108	201308	201508			
200309	200509	200709	200909	201109	201309	201509			
200310	200510	200710	200910	201110	201310	201510			
200311	200511	200711	200911	201111	201311	201511			
200312	200512	200712	200912	201112	201312	201512			

### 先行き判断

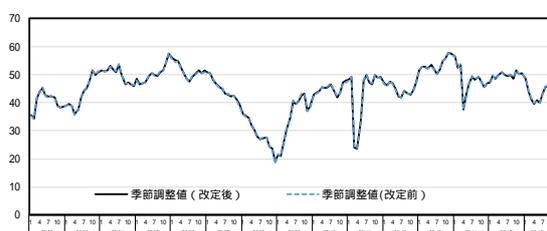
符号判定	符号判定	符号判定							
200201	200401	200601	200801	201001	201201	201401	201601		
200202	200402	200602	200802	201002	201202	201402	201602		
200203	200403	200603	200803	201003	201203	201403	201603		
200204	200404	200604	200804	201004	201204	201404	201604		
200205	200405	200605	200805	201005	201205	201405	201605		
200206	200406	200606	200806	201006	201206	201406	201606		
200207	200407	200607	200807	201007	201207	201407	201607		
200208	200408	200608	200808	201008	201208	201408	201608		
200209	200409	200609	200809	201009	201209	201409	201609		
200210	200410	200610	200810	201010	201210	201410			
200211	200411	200611	200811	201011	201211	201411			
200212	200412	200612	200812	201012	201212	201412			
200301	200501	200701	200901	201101	201301	201501			
200302	200502	200702	200902	201102	201302	201502			
200303	200503	200703	200903	201103	201303	201503			
200304	200504	200704	200904	201104	201304	201504			
200305	200505	200705	200905	201105	201305	201505			
200306	200506	200706	200906	201106	201306	201506			
200307	200507	200707	200907	201107	201307	201507			
200308	200508	200708	200908	201108	201308	201508			
200309	200509	200709	200909	201109	201309	201509			
200310	200510	200710	200910	201110	201310	201510			
200311	200511	200711	200911	201111	201311	201511			
200312	200512	200712	200912	201112	201312	201512			

### (3) 総合DIの変化

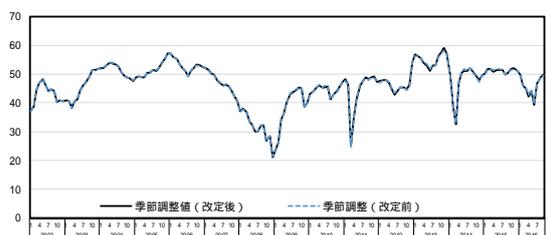
家計動向関連DIと企業動向関連DIを変えることで、総合DIも変化する。新旧の総合DIの比較をすると、現状判断でかい離率は平均-0.01%、最大3.26%、分散は0.38%、先行き判断で月次のかい離率は平均0.01%、最大1.76%、分散0.35%である(図表3-1)。指数としては、分野合成の分散が現状判断で新DIが60.66、現在のDIは60.62、先行き判断で新DIが50.02、現在のDIが49.91である。

図表3-1：総合DIの新旧比較

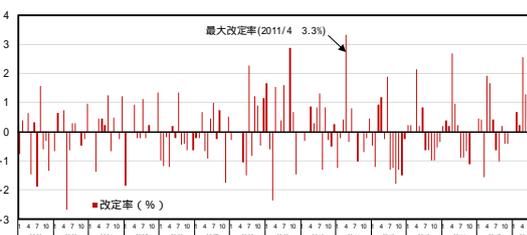
#### 現状判断



#### 先行き判断



#### 現状水準判断



細分化に伴い、DIの水準だけでなく前期差にも変化が生じる。DIの評価は変化の方向(増減)によることから、品質確認の一環として、改訂が変化の方向に与える影響も検証した。その結果、符号変化の発生は、現状は2回、先行きは7回、逆転が連続して生じる月はなかった。

図表3 - 2 : 新旧D I の符号判定

現状判断

符号判定	符号判定							
200201	200401	200601	200801	201001	201201	201401	201601	
200202	200402	200602	200802	201002	201202	201402	201602	
200203	200403	200603	200803	201003	201203	201403	201603	
200204	200404	200604	200804	201004	201204	201404	201604	
200205	200405	200605	200805	201005	201205	201405	201605	
200206	200406	200606	200806	201006	201206	201406	201606	
200207	200407	200607	200807	201007	201207	201407	201607	
200208	200408	200608	200808	201008	201208	201408	201608	
200209	200409	200609	200809	201009	201209	201409	201609	
200210	200410	200610	200810	201010	201210	201410		
200211	200411	200611	200811	201011	201211	201411		
200212	200412	200612	200812	201012	201212	201412		
200301	200501	200701	200901	201101	201301	201501		
200302	200502	200702	200902	201102	201302	201502		
200303	200503	200703	200903	201103	201303	201503		
200304	200504	200704	200904	201104	201304	201504		
200305	200505	200705	200905	201105	201305	201505		
200306	200506	200706	200906	201106	201306	201506		
200307	200507	200707	200907	201107	201307	201507		
200308	200508	200708	200908	201108	201308	201508		
200309	200509	200709	200909	201109	201309	201509		
200310	200510	200710	200910	201110	201310	201510		
200311	200511	200711	200911	201111	201311	201511		
200312	200512	200712	200912	201112	201312	201512		

先行き判断

符号判定	符号判定							
200201	200401	200601	200801	201001	201201	201401	201601	
200202	200402	200602	200802	201002	201202	201402	201602	
200203	200403	200603	200803	201003	201203	201403	201603	
200204	200404	200604	200804	201004	201204	201404	201604	
200205	200405	200605	200805	201005	201205	201405	201605	
200206	200406	200606	200806	201006	201206	201406	201606	
200207	200407	200607	200807	201007	201207	201407	201607	
200208	200408	200608	200808	201008	201208	201408	201608	
200209	200409	200609	200809	201009	201209	201409	201609	
200210	200410	200610	200810	201010	201210	201410		
200211	200411	200611	200811	201011	201211	201411		
200212	200412	200612	200812	201012	201212	201412		
200301	200501	200701	200901	201101	201301	201501		
200302	200502	200702	200902	201102	201302	201502		
200303	200503	200703	200903	201103	201303	201503		
200304	200504	200704	200904	201104	201304	201504		
200305	200505	200705	200905	201105	201305	201505		
200306	200506	200706	200906	201106	201306	201506		
200307	200507	200707	200907	201107	201307	201507		
200308	200508	200708	200908	201108	201308	201508		
200309	200509	200709	200909	201109	201309	201509		
200310	200510	200710	200910	201110	201310	201510		
200311	200511	200711	200911	201111	201311	201511		
200312	200512	200712	200912	201112	201312	201512		

### 3 季節調整の方法

各系列に選定したモデルは下記の表のとおり。季節調整に使用したデータ期間は、2002年1月～2015年12月。

#### 季節調整のスペック概要一覧

##### 現状判断D I

分類名	家計動向関連D I				企業動向関連D I	
	小売関連	飲食関連	サービス関連	住宅関連	製造業	非製造業
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	TD1NOLPYEAR HOL1	なし	なし	なし	なし	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar TC2014.Apr	TC2011.Mar TC2011.Jun	TC2011.Mar TC2011.Jun	TC2011.Mar	TC2011.Mar	TC2008.Dec TC2011.Mar LS2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(3 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>						
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×9)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は60か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は12か月 MAPRが最小

##### 先行き判断D I

分類名	家計動向関連D I				企業動向関連D I	
	小売関連	飲食関連	サービス関連	住宅関連	製造業	非製造業
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	LPYEAR	-	-	LPYEAR	-	-
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2008.Dec LS2009.Mar TC2009.Nov TC2011.Mar AO2014.Jan LS2014.Feb TC2014.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar TC2014.Feb	TC2008.Dec TC2011.Mar	TC2011.Mar	TC2008.Dec TC2011.Mar	TC2008.Dec LS2009.Mar TC2009.Nov TC2011.Mar AO2014.Mar
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>						
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×9)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	9項	13項	9項	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は60か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小

##### 現状水準判断D I

分類名	家計動向関連D I				企業動向関連D I	
	小売関連	飲食関連	サービス関連	住宅関連	製造業	非製造業
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	なし	なし	なし	なし	HOL2	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar	TC2011.Mar AO2014.Apr	TC2011.Mar	LS2011.Mar	TC2011.Mar LS2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(2 1 0)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(1 1 0)(0 1 1)	(1 1 0)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>						
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項	13項	9項	9項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は12か月 MAPRが最小

[地域]

水準 D I

分野名	北海道	東北	北関東	南関東	東海	北陸
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	なし	TD1NOLPYEAR HOL1	なし	なし	TDNOLPYEAR	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar AO2014.Feb TC2014.Apr	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar TC2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 0)(0 1 1)	(0 1 0)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(3 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>						
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×9)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小

分野名	近畿	中国	四国	九州	沖縄
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	なし	なし	なし	TD1NOLPYEAR HOL1	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar LS2014.Apr	LS2014.Apr	TC2011.Mar AO2014.Apr	
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>					
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×9)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は60か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小

「東北（新潟除く）」「北関東（山梨・長野除く）」「甲信越」

[東北（新潟除く）]

分野名	現状判断DI	先行き判断DI	水準判断DI
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	TD1NOLPYEAR HOL1	なし	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar TC2011.Jun AO2011.Jul TC2014.Apr	TC2008.Dec TC2011.Mar LS2014.Apr	TC2011.Mar TC2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 1)(0 0 0)	(0 1 0)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>			
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	9項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は24か月 MAPRが最小	予測期間は48か月 MAPRが最小

[北関東（山梨・長野除く）]

分野名	現状判断DI	先行き判断DI	水準判断DI
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	なし	なし	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar TC2011.Jun TC2014.Apr	TC2011.Mar AO2014.Mar	TC2011.Mar LS2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 0)(0 1 1)	(1 0 0)(1 0 1)	(0 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>			
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5	下限1.5 上限2.5
その他	予測期間は48か月 MAPRが最小	予測期間は60か月 MAPRが最小	予測期間は36か月 MAPRが最小

[甲信越]

分野名	現状判断DI	先行き判断DI	水準判断DI
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	なし	なし	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar	TC2011.Mar	TC2011.Mar
	TC2014.Feb	TC2014.Feb	A02014.Feb
	TC2014.Apr	A02014.Mar	TC2014.Apr
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 0)(0 1 1)	(0 1 0)(0 1 1)	(3 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>			
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5	下限1.5	下限1.5
	上限2.5	上限2.5	上限2.5
その他	予測期間は36か月	予測期間は24か月	予測期間は36か月
	MAPRが最小	MAPRが最小	MAPRが最小

「東京都」

分野名	現状判断DI	先行き判断DI	水準判断DI
曜日調整 <sup>(注1)</sup>	LPYEAR	LPYEAR	なし
異常値 <sup>(注1)</sup>	TC2011.Mar	TC2011.Mar	TC2011.Mar
	TC2011.Jun	LS2012.Dec	LS2014.Apr
	TC2014.Apr	TC2014.Feb	
ARIMAモデル <sup>(注2)</sup>	(0 1 1)(0 1 1)	(0 1 0)(0 1 1)	(0 1 1)(0 1 1)
X11パートの設定 <sup>(注3)</sup>			
1. モデルのタイプ	加法型	加法型	加法型
2. 移動平均項数	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)	Seasonal ma=MSR(3×5)
3. ヘンダーソン移動平均項数	13項	13項	13項
4. 特異項の管理限界	下限1.5	下限1.5	下限1.5
	上限2.5	上限2.5	上限2.5
その他	予測期間は24か月	予測期間は24か月	予測期間は24か月
	MAPRが最小	MAPRが最小	MAPRが最小

- (注1) 各種曜日調整と閏年調整の適否判定は、推定パラメタの t 値等による。また、異常値検出については、X-12-ARIMA の outlier コマンドを用いている。
- (注2) ARIMA モデルの次数選定は、先決した階差に AR 及び MA の次数候補(0~3)を変化させてモデルを推計し、AIC を基準に選定している。ただし、それ以外の情報量基準や MAPR も参照して選定している。
- (注3) X-11 パートの設定項目は、総務省「季節調整法に関する各省庁からの報告取りまとめ」に準拠している。

(備考)

- TDNOLPYEAR：日曜の数を基準として月曜から土曜の構成割合の変化を示し、かつ、閏年による2月の日数変動を考慮しない場合の曜日効果。
- TD1NOLPYEAR：週末日(土日)の数を基準として平日と週末日の構成割合の変化を示し、かつ、閏年による2月の日数変動を考慮しない場合の曜日効果。
- LPYEAR：閏年の調整をする変数で、閏年の2月は0.75、閏年以外の年の2月は-0.25、それ以外の月には0.0の数値が与えられている回帰変数。
- HOL1:すべての土曜日を休みとし、さらに月～金における祝日を加えて休日数をカウントした日本型曜日調整の変数。
- HOL2:HOL1 に年末年始の休み、ゴールデンウィーク、お盆休みを加えて休日数をカウントした日本型曜日調整の変数。

TC: 減衰的外れ値 (temporary level change)。ある 1 時点のショック後、その影響が弱まっていく変化を除去するもの。

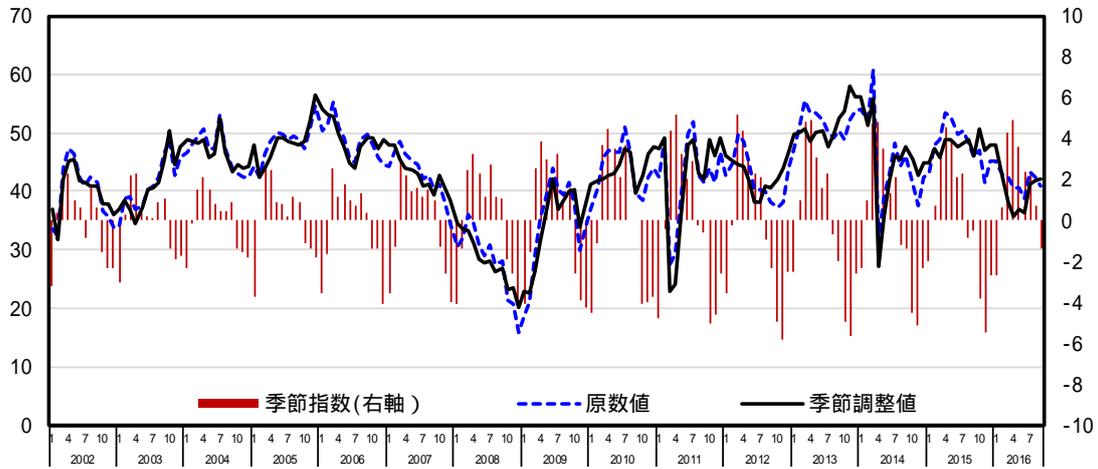
LS: 水準変化 (level shift)。ある 1 時点においてデータの性質が変化し、データに段差が発生する場合に対処する回帰変数。

A0: 加法的な外れ値 (additive outlier)。ある 1 時点の特殊変動を除去するもの。

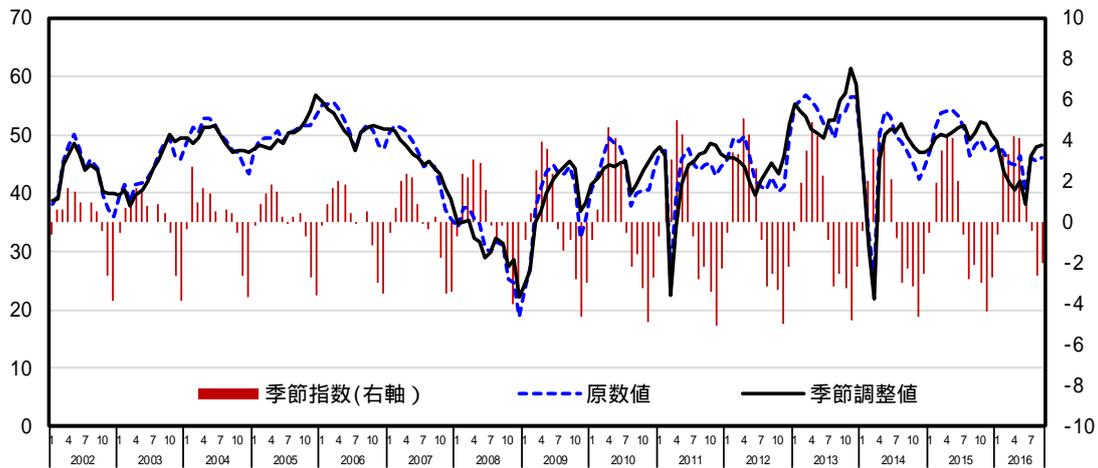
(参考) 家計動向関連 4 分野、企業動向関連 2 分野の季節調整

(1) 小売関連 D I (原系列、季節調整系列(新規))

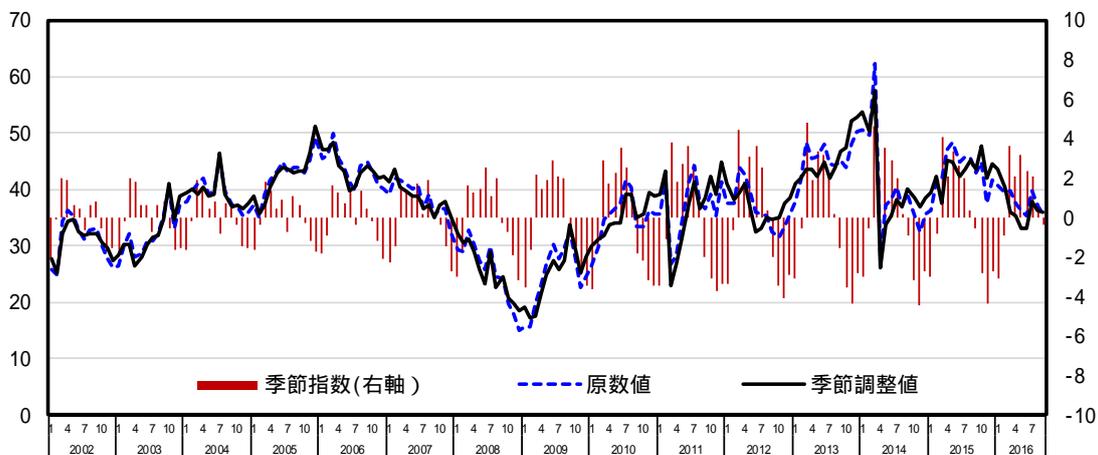
[現状判断]



[先行き判断]

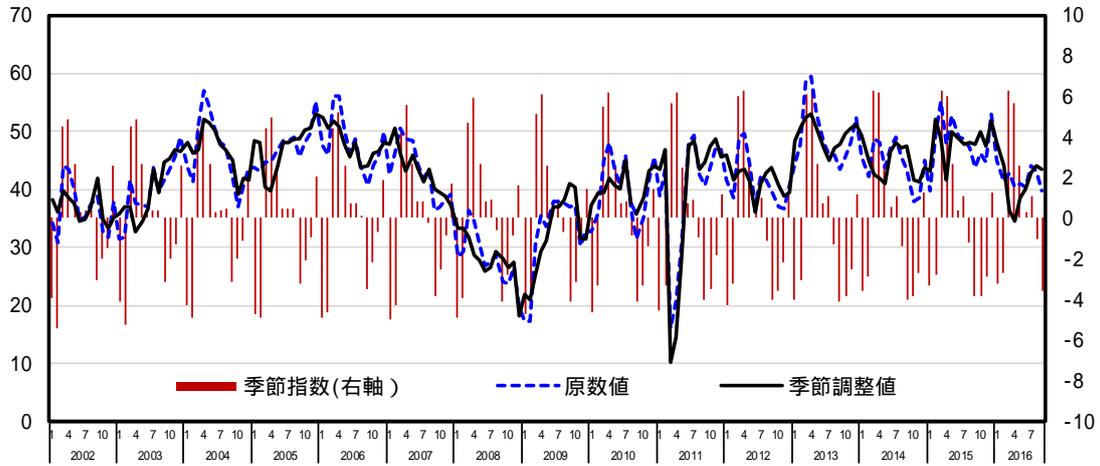


[現状水準判断]

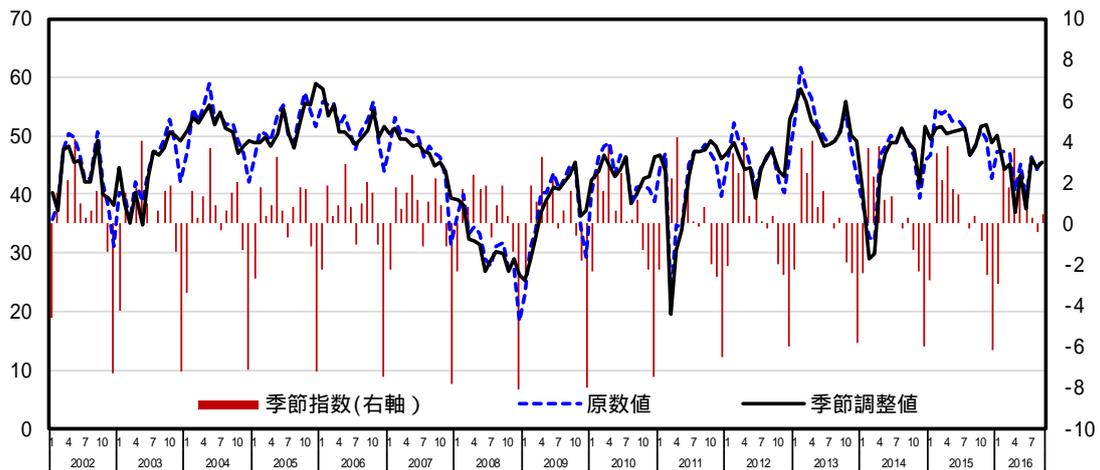


( 2 ) 飲食関連D I ( 原系列、季節調整系列 ( 新規 ) )

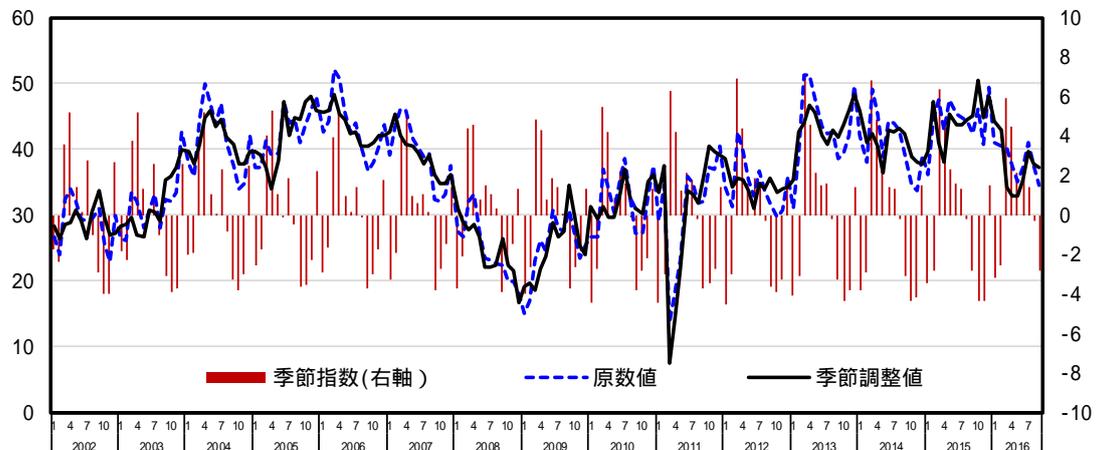
[ 現状判断 ]



[ 先行き判断 ]

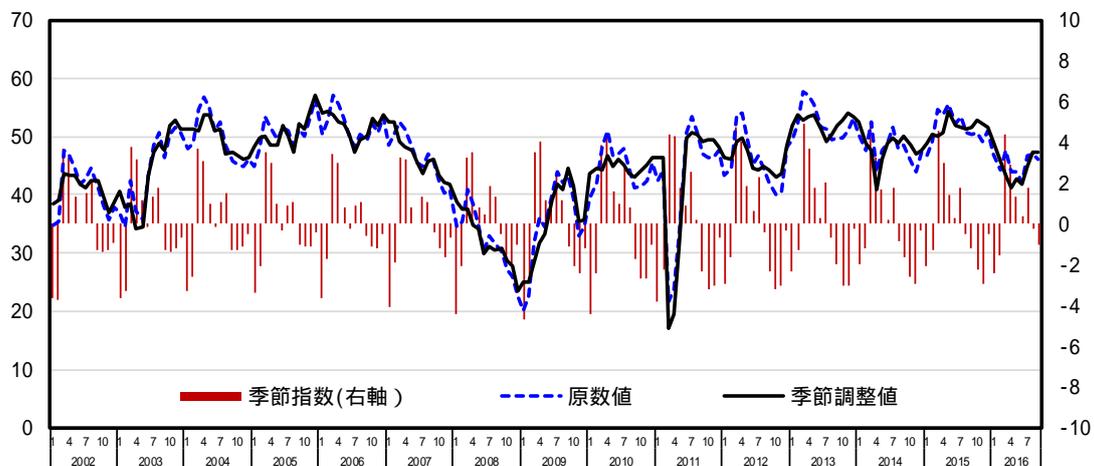


[ 現状水準判断 ]

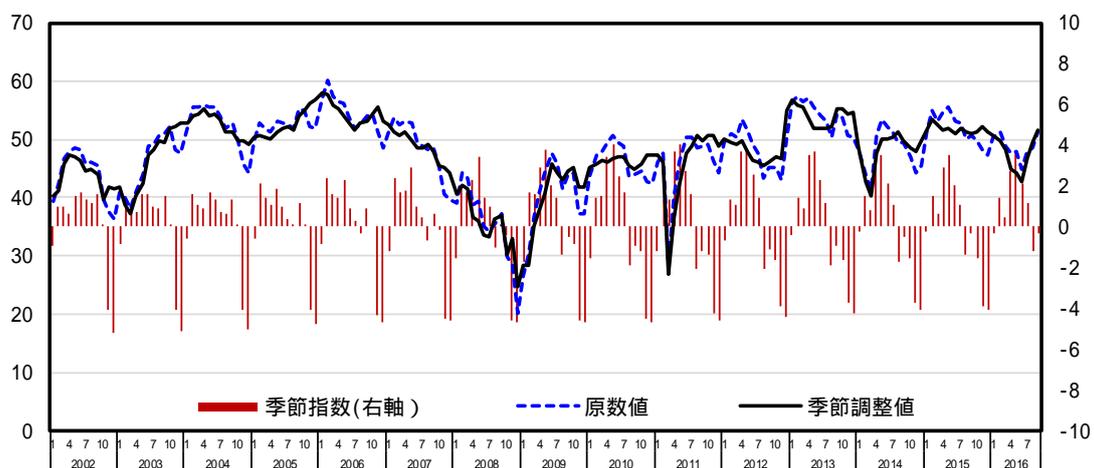


( 3 ) サービス関連D I ( 原系列、季節調整系列 ( 新規 ) )

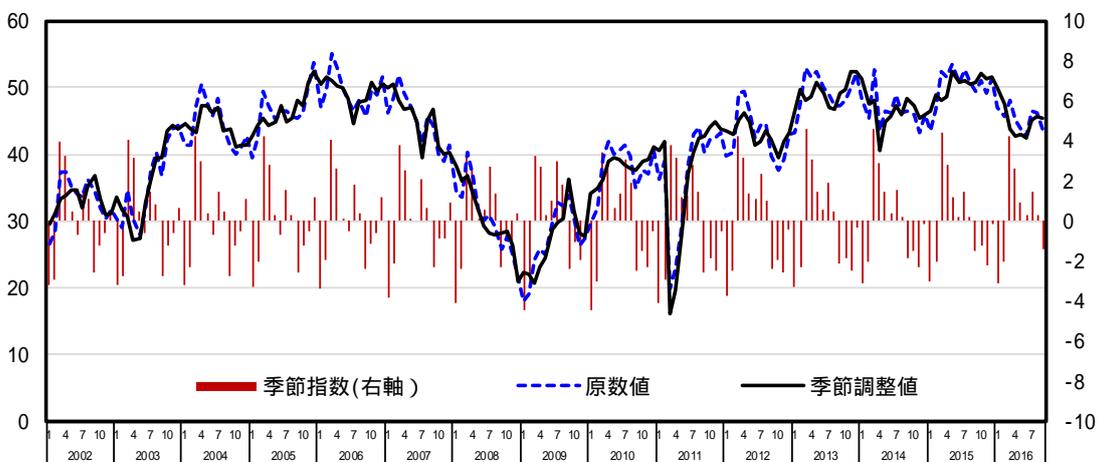
[ 現状判断 ]



[ 先行き判断 ]

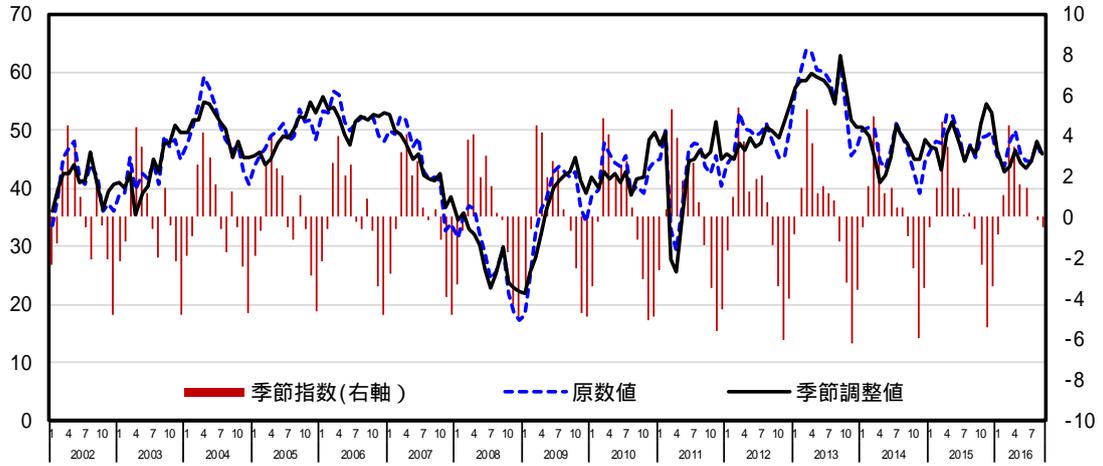


[ 現状水準判断 ]

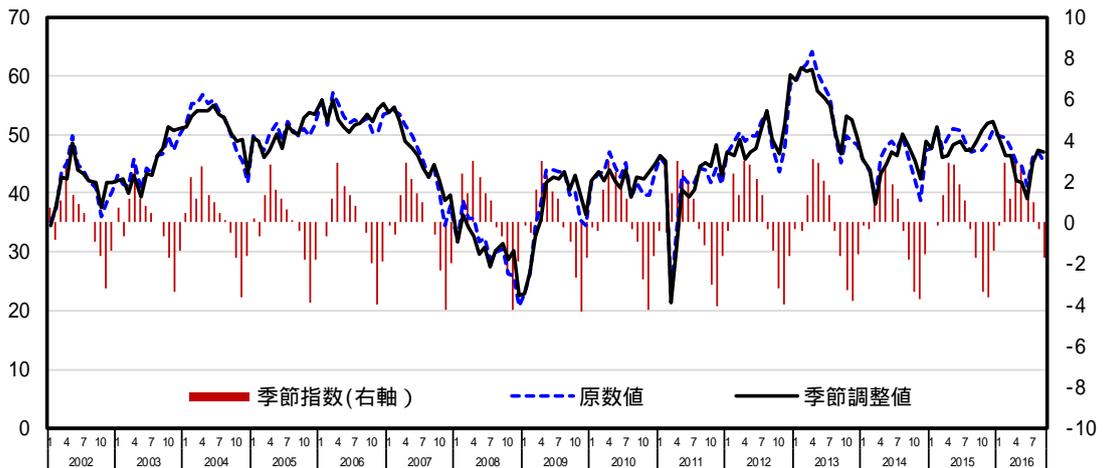


(4) 住宅関連D I (原系列、季節調整系列(新規))

[現状判断]



[先行き判断]

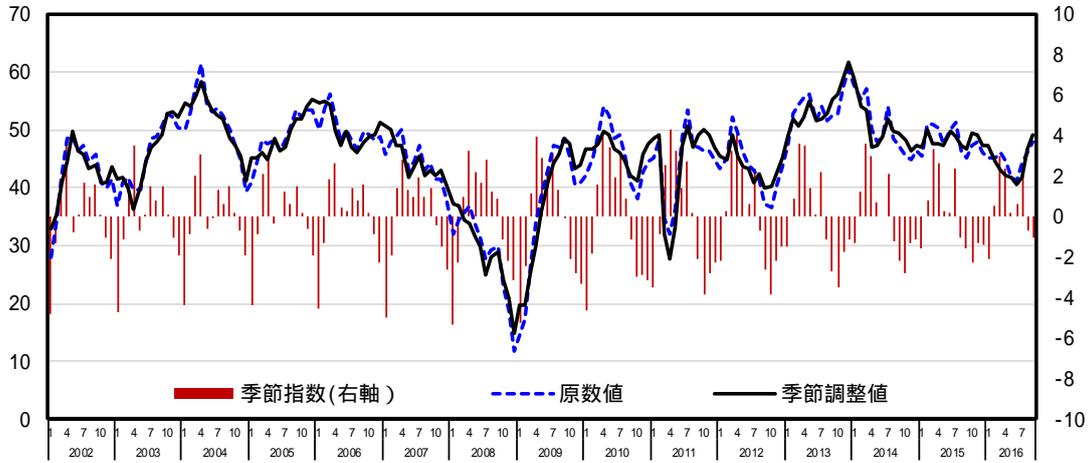


[現状水準判断]

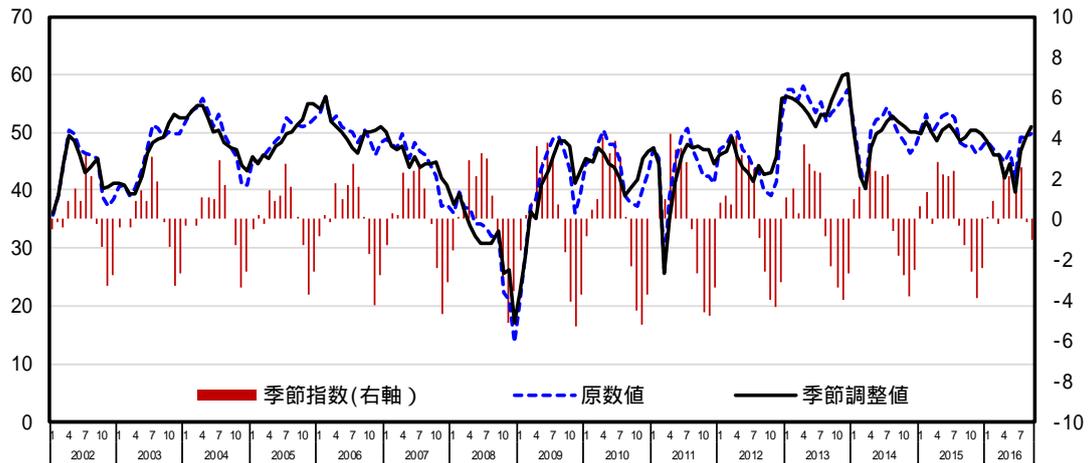


( 5 ) 製造業D I ( 原系列、季節調整系列 ( 新規 ) )

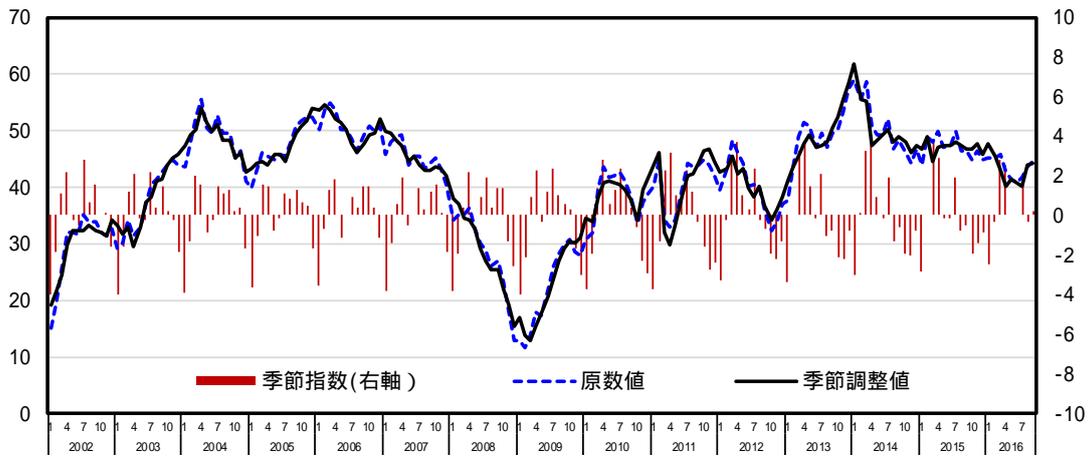
[ 現状判断 ]



[ 先行き判断 ]

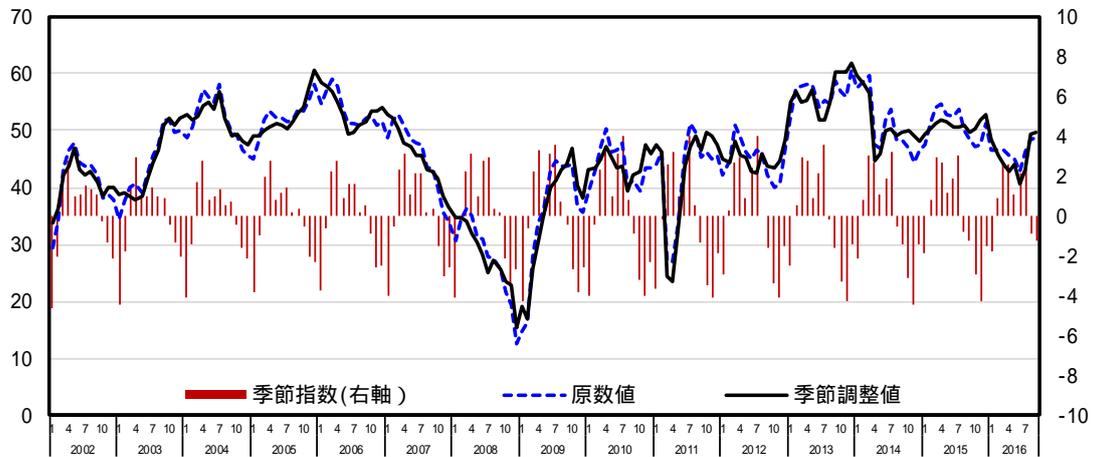


[ 現状水準判断 ]

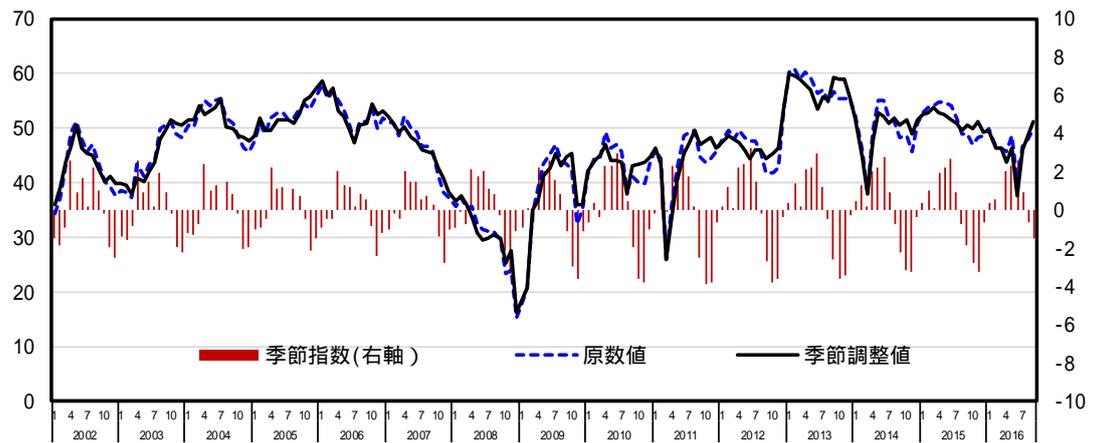


( 6 ) 非製造業 D I ( 原系列、季節調整系列 ( 新規 ) )

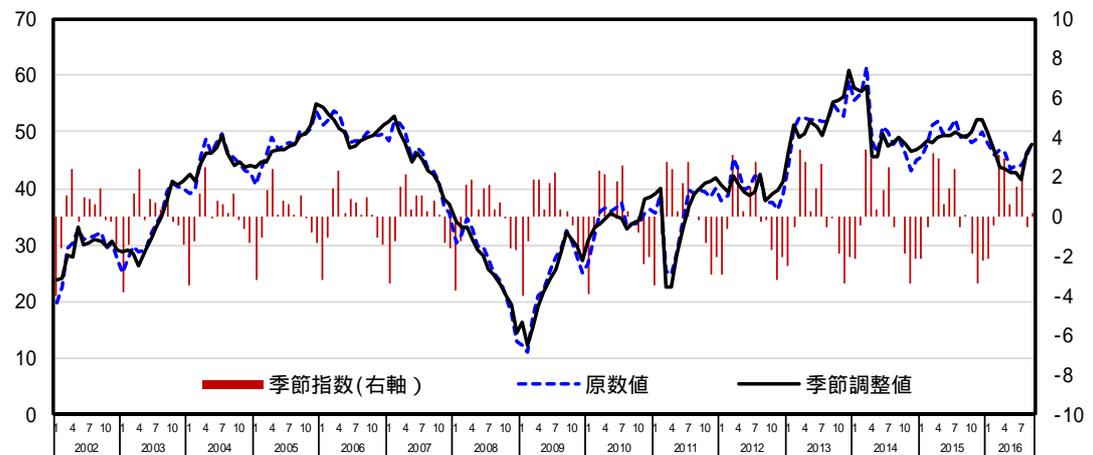
[ 現状判断 ]



[ 先行き判断 ]

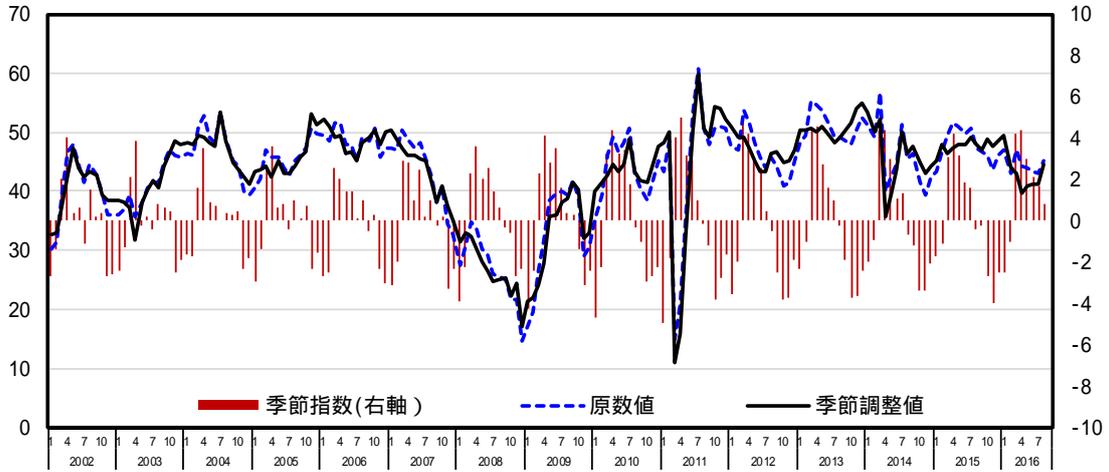


[ 現状水準判断 ]

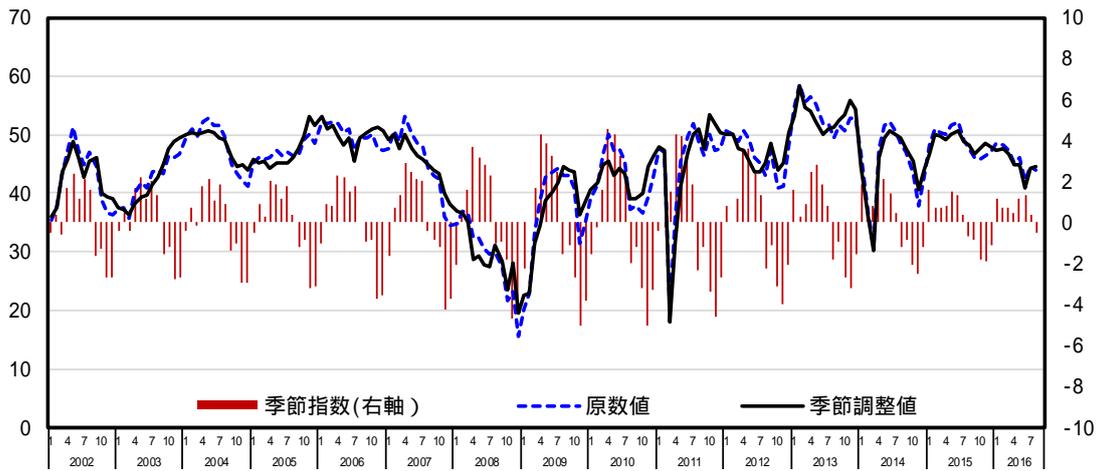


(7) 東北(新潟除く)DI (原系列、季節調整系列(新規))

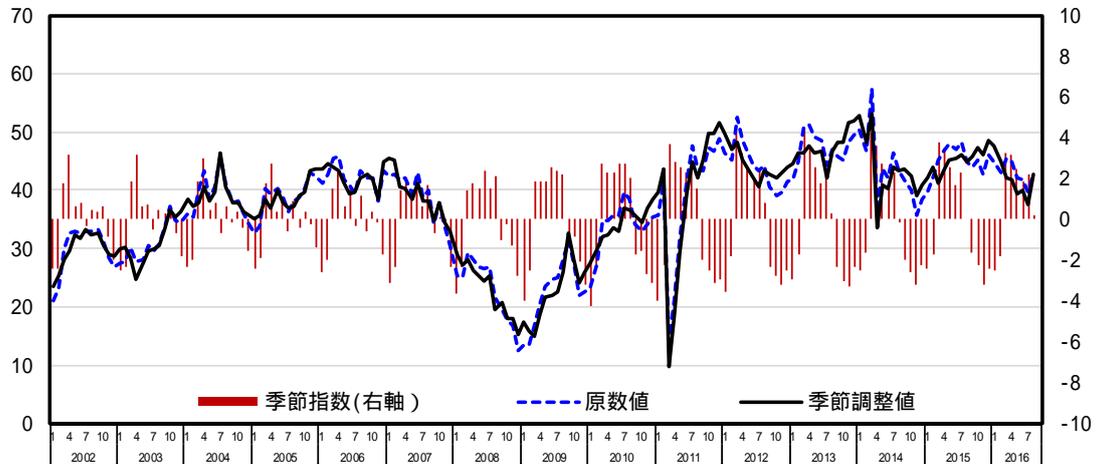
[現状判断]



[先行き判断]

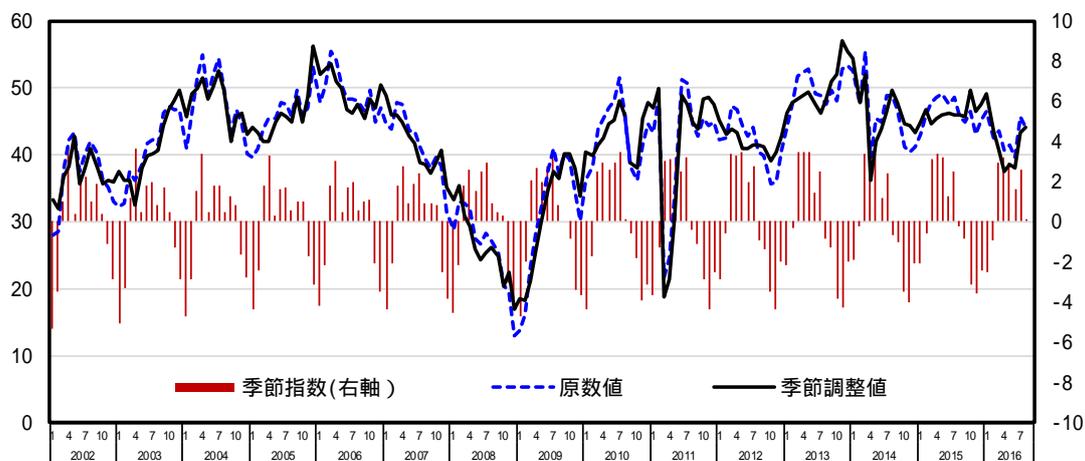


[現状水準判断]

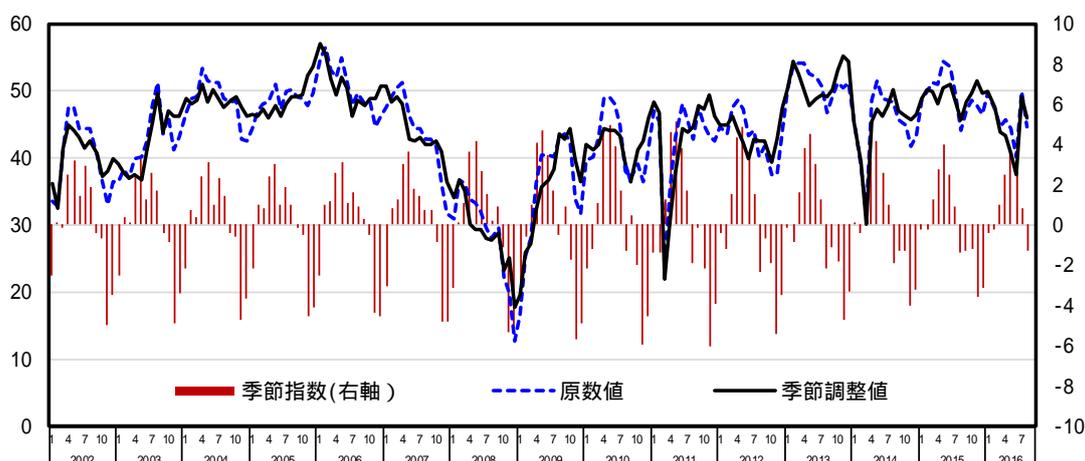


( 8 ) 北関東(山梨・長野除く)DI(原系列、季節調整系列(新規))

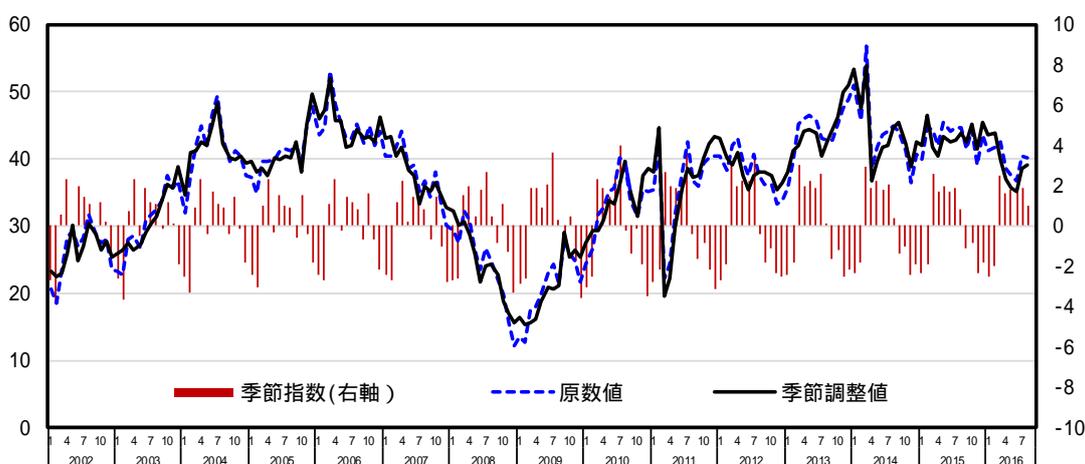
[現状判断]



[先行き判断]

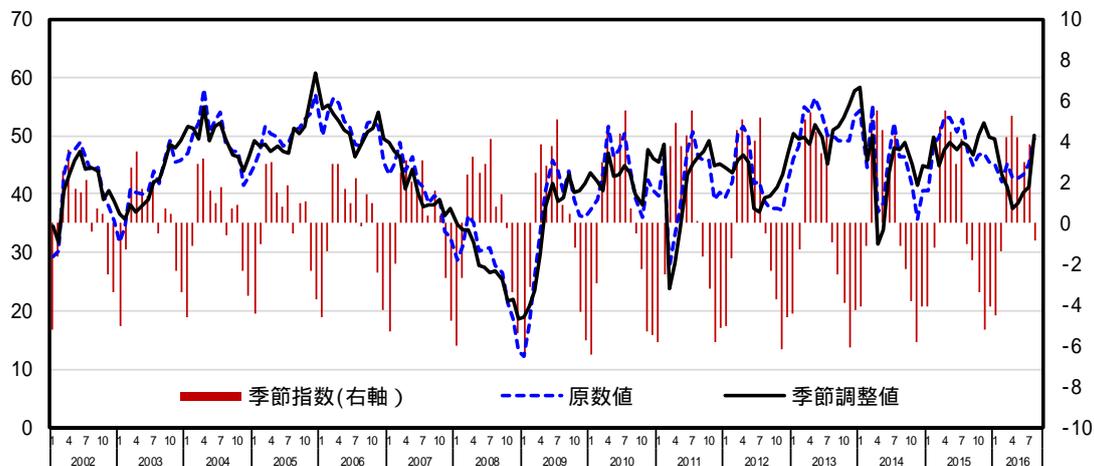


[現状水準判断]

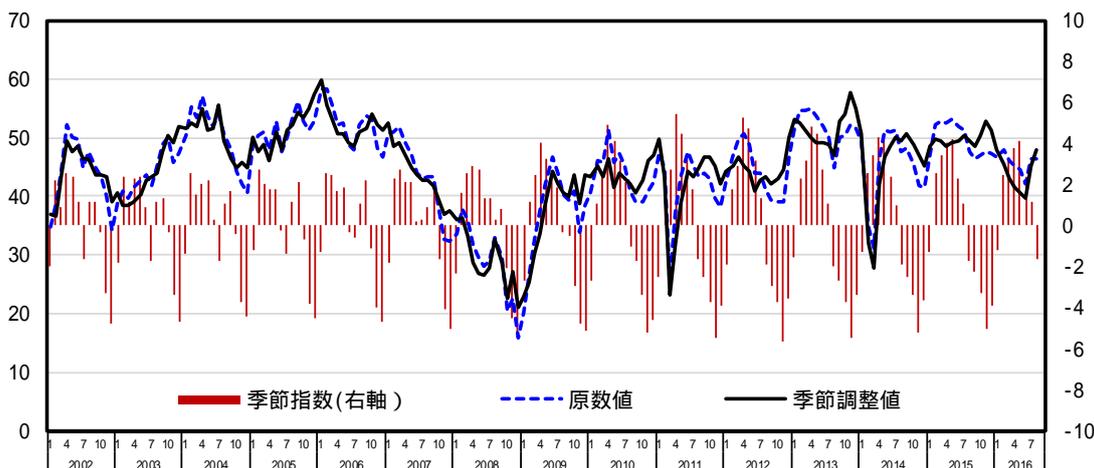


( 9 ) 甲信越D I ( 原系列、季節調整系列 ( 新規 ) )

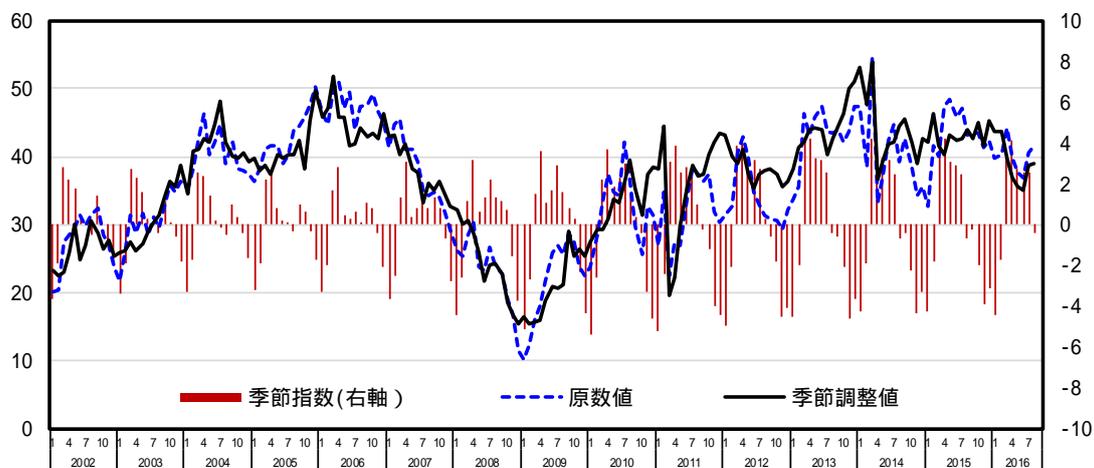
[ 現状判断 ]



[ 先行き判断 ]

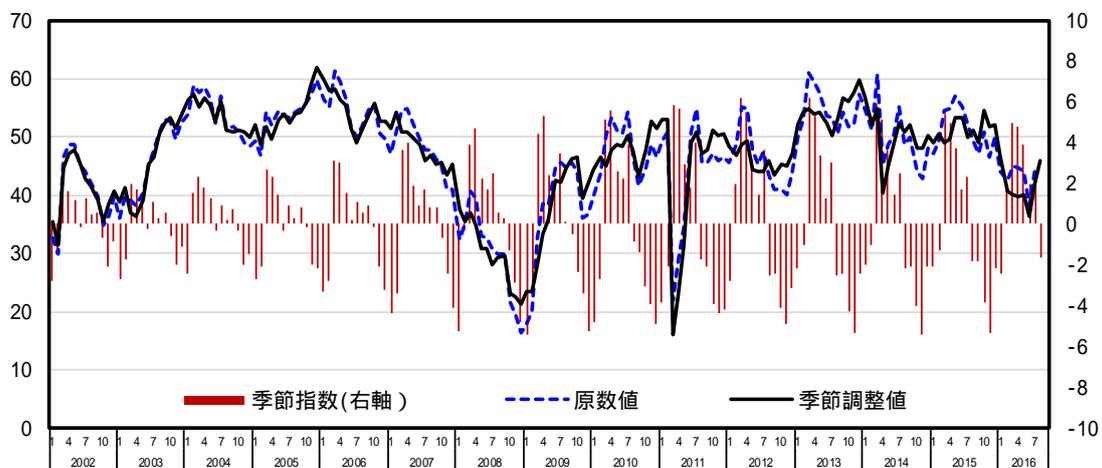


[ 現状水準判断 ]

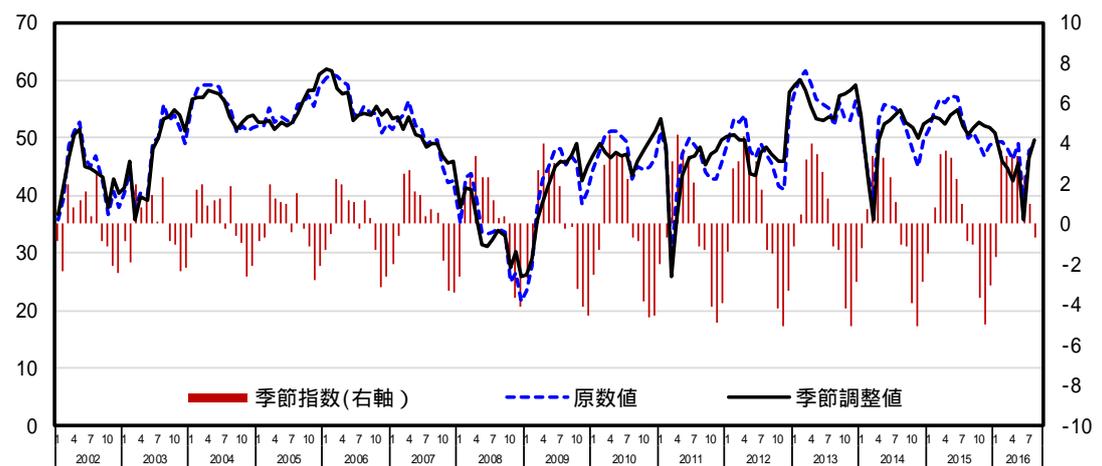


(10) 東京都D I (原系列、季節調整系列(新規))

[現状判断]



[先行き判断]



[現状水準判断]

