

表1 今回の比較で用いた季節調整法一覧表

	X-12-ARIMA		X-11
	あり(maxlead=4)	なし(maxlead=0)	なし
予測機能を利用した計算	あり(maxlead=4)	なし(maxlead=0)	なし
曜日/閏年調整なし	ケース (注)	ケース (注)	ケース
曜日/閏年調整あり	ケース	ケース	ケース (X-11-Regression)
曜日/閏年調整の方法の概要	<p>・原系列を被説明変数とし、曜日調整、閏年調整、異常値処理等のためのダミー変数を説明変数とする回帰推計を行う。</p> <p>・原系列から回帰式で説明される部分を除いた系列が季節ARIMAモデルに従うものとして定式化する。</p> <p>・回帰式とARIMAモデルのパラメータの推計は収束計算により同時に決定される。</p> <p>・季節指数は、季節ARIMAモデルにより定式化される系列(' の場合は予測値をつなぎ合わせた系列)を、事前調整済原系列としてそれにX11を適用し、算出。</p>		<p>・特異項修正後の暫定的な不規則変動成分を被説明変数とし、各曜日の期間内構成比を説明変数とする回帰を行う。</p> <p>・曜日調整の過程で、各曜日の期間内構成比算出の際に、2月の月内総日数を28.25日とすることにより、閏年調整を行う。</p> <p>・回帰式のパラメータはX11の計算過程の中で決定される。</p>

(注) X-12-ARIMAの「曜日/閏年調整なし」のケースでも、異常値が検出された場合はその処理のための回帰変数を用いている。
 なお、X-12-ARIMAで全く回帰変数を用いず、かつ予測値を計算に利用しない(maxlead=0)場合は、X-11と同じ結果が得られる。

