

表2 季節調整法の比較結果

系列	ケース		選択されたARIMA モデル(AIC最小)	曜日調整 (p-value)	閏年調整 (t-value)	異常値・レベルシフト		MAPR(91年以降)		AIC値	
						種類、期	t-value	MAXLEAD=4	MAXLEAD=0		
国内家計最終消費支出 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 1)(1 1 0)	-	-	AO1997.1	4.57	0.19	-	1117.2561
			閏年調整のみ	(1 1 0)(1 1 0)	-	0.97	AO1997.1	4.65	0.18	-	1118.5824
		曜日、閏年調整	(1 1 0)(1 1 0)	0.04	1.10	AO1997.1	5.43	0.23	0.26	1119.0283	
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.01				0.26			
		X-11					0.23				
国内家計最終消費支出 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(1 1 0)	-	-	AO1997.1	4.65	0.18	-	1132.1910
			閏年調整のみ	(2 1 2)(1 1 0)	-	1.79	AO1997.1	4.81	0.17	-	1131.2304
		曜日、閏年調整	(2 1 2)(1 1 0)	0.00	2.15	AO1997.1	7.01	0.20	0.25	1129.0261	
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.01				0.24			
		X-11					0.19				
居住者家計の海外での直接購入 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(1 1 0)	-	-	LS1988.2	5.12	1.04	1.07	665.6559
			閏年調整のみ	(2 1 2)(1 1 0)	-	1.83	LS1988.2	5.74	1.07	-	664.2868
		曜日、閏年調整	(2 1 2)(1 1 0)	0.96	1.82	LS1988.2	5.72	1.38	-	674.8928	
		TC1991.1									
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.11				1.33			
		X-11					1.26				
居住者家計の海外での直接購入 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(1 1 1)(0 1 1)	-	-	TC1991.1	-5.41	1.11	1.01	675.9021
			閏年調整のみ	(1 1 0)(0 1 1)	-	0.45	TC1991.1	-5.39	1.22	-	677.7262
		曜日、閏年調整	(0 1 2)(0 1 1)	0.00	0.64	TC1991.1	-4.14	1.40	-	673.8326	
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.00				1.32			
		X-11					1.14				
非居住者家計の国内での直接購入 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 0)(1 1 2)	-	-	-	-	1.97	2.04	505.9271
			閏年調整のみ	(0 1 0)(1 1 1)	-	0.96	-	-	1.97	-	507.1600
		曜日、閏年調整	(0 1 0)(0 1 1)	0.00	0.73	-	-	2.50	-	497.1699	
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.00				2.17			
		X-11					2.04				

系列	ケース	選択されたARIMA モデル(AIC最小)	曜日調整 (p-value)	閏年調整 (t-value)	異常値・レベルシフト		MAPR(91年以降)		AIC値		
					種類、期	t-value	MAXLEAD=4	MAXLEAD=0			
非居住者家計の国内での直接購入 (実質)	or ' ' ' ' ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(010)(112)	-	-	-	-	2.00	2.10	517.3165
		閏年調整のみ	(010)(111)	-	1.02	-	-	-	1.96	-	518.3488
		曜日、閏年調整	(010)(011)	0.00	0.76	-	-	-	2.58	-	508.2957
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.00					2.20		
		X-11							2.10		
対家計民間非営利団体最終消費支出 (名目)	or ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(011)(010)	-	-	AO1993.1	5.70	1.95	2.11	821.9086
		X-11							2.10		
対家計民間非営利団体最終消費支出 (実質)	or ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(011)(213)	-	-	TC1993.1	5.19	1.96	2.55	838.0659
		X-11							2.32		
政府個別消費支出 (名目)	or ' ' ' ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(110)(010)	-	-	AO1990.4	3.82	0.33	0.45	876.4245
		閏年調整のみ	(110)(010)	-	-0.69	AO1990.4	3.86	0.32	-	-	877.9495
		曜日、閏年調整	(312)(012)	0.00	-2.32	AO1990.4	6.82	0.38	-	-	879.0998
		X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.00					0.53		
		X-11							0.49		
政府個別消費支出 (実質)	or ' ' ' ' ' ' ' ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(110)(011)	-	-	LS1984.4	-6.58	0.16	0.21	820.4565
		TC1984.4						3.84			
		LS1990.1						4.34			
		TC1992.2						-4.25			
		閏年調整のみ	(110)(011)	-	0.10	LS1984.4	-6.55	0.16	-	-	822.4473
		TC1984.4						3.83			
		LS1990.1						4.33			
		TC1992.2						-4.14			
		曜日、閏年調整	(312)(010)	0.00	-1.27	LS1984.4	-8.37	0.19	-	-	815.0782
		TC1984.4						5.07			
LS1990.1						2.94					
TC1992.2						-6.66					
X-11Regression(曜日、閏年調整)		0.00						0.24			
X-11								0.24			
政府集合消費支出 (名目)	or ' X-11	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(011)(010)	-	-	TC1982.4	-6.01	0.44	0.57	823.1255
		TC1983.4						-4.10			
		X-11							0.57		

系列	ケース		選択されたARIMA モデル(AIC最小)	曜日調整 (p-value)	閏年調整 (t-value)	異常値・レベルシフト		MAPR(91年以降)		AIC値	
						種類、期	t-value	MAXLEAD=4	MAXLEAD=0		
政府集合消費支出 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(1 1 1)(3 1 1)	-	-	LS1990.1	-7.26	0.14	0.16	805.0170
		X-11							0.19		
民間住宅投資 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 1)(0 1 1)	-	-	-	-	0.97	0.96	996.3643
		X-11							0.96		
民間住宅投資 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 1)(0 1 1)	-	-	-	-	0.99	0.97	1008.8542
		X-11							0.97		
民間企業設備投資 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 0)(2 1 2)	-	-	LS1997.1	5.52	0.71	0.51	1088.9487
		X-11							0.69		
民間企業設備投資 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 0)(0 1 1)	-	-	-	-	0.60	0.61	1094.0763
		X-11							0.61		
公的固定資本形成住宅 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(1 1 2)(2 1 2)	-	-	AO1980.2	-6.93	1.39	1.35	589.2542
		X-11					TC1986.1	6.11			
公的固定資本形成住宅 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(1 1 2)(2 1 2)	-	-	LS1991.4	5.83			599.6290
		X-11					AO1995.2	7.61	1.84		
公的固定資本形成企業設備 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(1 1 1)	-	-	LS1985.2	-9.05	1.52	1.67	862.3596
		X-11					TC1991.2	-4.58	1.92		
公的固定資本形成企業設備 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 0)(2 1 3)	-	-	-	-	1.68	2.28	899.8095
		X-11							2.28		
公的固定資本形成一般政府 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 1)(0 1 0)	-	-	LS1996.3	-6.66	1.01	1.14	994.6480
		X-11					TC1998.3	-5.09	1.36		

系列	ケース		選択されたARIMA モデル(AIC最小)	曜日調整 (p-value)	閏年調整 (t-value)	異常値・レベルシフト		MAPR(91年以降)		AIC値		
						種類、期	t-value	MAXLEAD=4	MAXLEAD=0			
公的固定資本形成一般政府 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(0 1 0)	-	-	LS1996.3	-6.93	1.07	1.19	1007.0289	
		X-11								1.22		
民間企業在庫品増加 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 3)(0 1 1)	-	-	-	-	74.93	70.82	1042.2002	
		X-11							70.82			
民間企業在庫品増加 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 3)(1 1 3)	-	-	AO1993.2	5.08	42.51	46.63	1016.0950	
		X-11							60.87			
公的企業在庫品増加 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 3)(0 1 1)	-	-	AO1985.4	6.56	20.37	24.56	833.1876	
		X-11					TC1986.2	9.23				23.77
公的企業在庫品増加 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(1 1 1)(1 1 0)	-	-	-	-	15.81	15.20	853.9803	
		X-11							15.20			
一般政府在庫品増加 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 3)(0 1 1)	-	-	LS1980.3	4.58	13.65	17.53	578.5988	
		X-11					LS1982.1	-7.22				17.72
一般政府在庫品増加 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 2)(0 1 1)	-	-	-	-	12.17	12.85	473.5166	
		X-11							12.85			
財貨・サービスの輸出 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 2)(3 1 0)	-	-	-	-	0.77	0.72	1100.1553	
		X-12-ARIMA	閏年調整のみ	(3 1 2)(3 1 0)	-	-0.35	-	-	0.78	-		1102.0396
		X-12-ARIMA	曜日、閏年調整	(3 1 1)(1 1 2)	0.00	-3.22	-	-	0.92	-		1101.9238
		X-11Regression(曜日・閏年調整)			0.00				0.73			
財貨・サービスの輸出 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 1)(0 1 2)	-	-	-	-	0.54	0.50	1007.1171	
		X-12-ARIMA	閏年調整のみ	(3 1 1)(0 1 2)	-	0.86	-	-	0.54	-		1008.3793
		X-12-ARIMA	曜日、閏年調整	(3 1 1)(1 1 2)	0.08	-0.49	-	-	0.59	-		1012.1523
		X-11Regression(曜日・閏年調整)			0.00				0.49			
		X-11						0.50				

系列	ケース	選択されたARIMA モデル(AIC最小)	曜日調整 (p-value)	閏年調整 (t-value)	異常値・レベルシフト		MAPR(91年以降)		AIC値		
					種類、期	t-value	MAXLEAD=4	MAXLEAD=0			
財貨・サービスの輸入 (名目)	or : : :	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(0 1 3)	-	-	-	-	0.47	0.55	1107.2889
			閏年調整のみ	(2 1 0)(2 1 1)	-	-1.21	-	-	0.48	-	1108.5897
			曜日、閏年調整	(2 1 0)(0 1 1)	0.01	-2.10	-	-	0.48	-	1105.9933
		X-11Regression(曜日・閏年調整)			0.00				0.65		
	X-11							0.55			
財貨・サービスの輸入 (実質)	or : : :	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 2)(0 1 2)	-	-	-	-	0.34	0.34	988.4780
			閏年調整のみ	(2 1 2)(0 1 2)	-	-0.35	-	-	0.32	-	990.3689
			曜日、閏年調整	(2 1 2)(0 1 2)	0.97	-0.40	-	-	0.38	-	1000.9993
		X-11Regression(曜日・閏年調整)			0.22				0.36		
	X-11							0.34			
海外からの所得の受取 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 0)(0 1 1)	-	-	LS1983.1 LS1996.1	-4.35 -6.51	1.56	1.28	993.4108
		X-11							1.19		
海外からの所得の受取 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(0 1 0)(0 1 1)	-	-	LS1983.1 LS1996.1	-4.35 -6.51	1.51	1.19	1002.0709
		X-11							1.24		
海外に対する所得の支払 (名目)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(2 1 3)(2 1 2)	-	-	LS1996.1	-10.94	2.17	1.50	968.2764
		X-11							1.87		
海外に対する所得の支払 (実質)	or	X-12-ARIMA	曜日、閏年調整なし	(3 1 2)(2 1 2)	-	-	LS1996.1	-10.84	2.07	1.50	977.5673
		X-11							1.86		

(注) 使用した系列のデータ期間は1980年第1四半期～1999年第1四半期。  
p値は0.05以下、t値は2以上を有意とした。