

(資料2 - 9) 新旧CIとDIのパフォーマンス

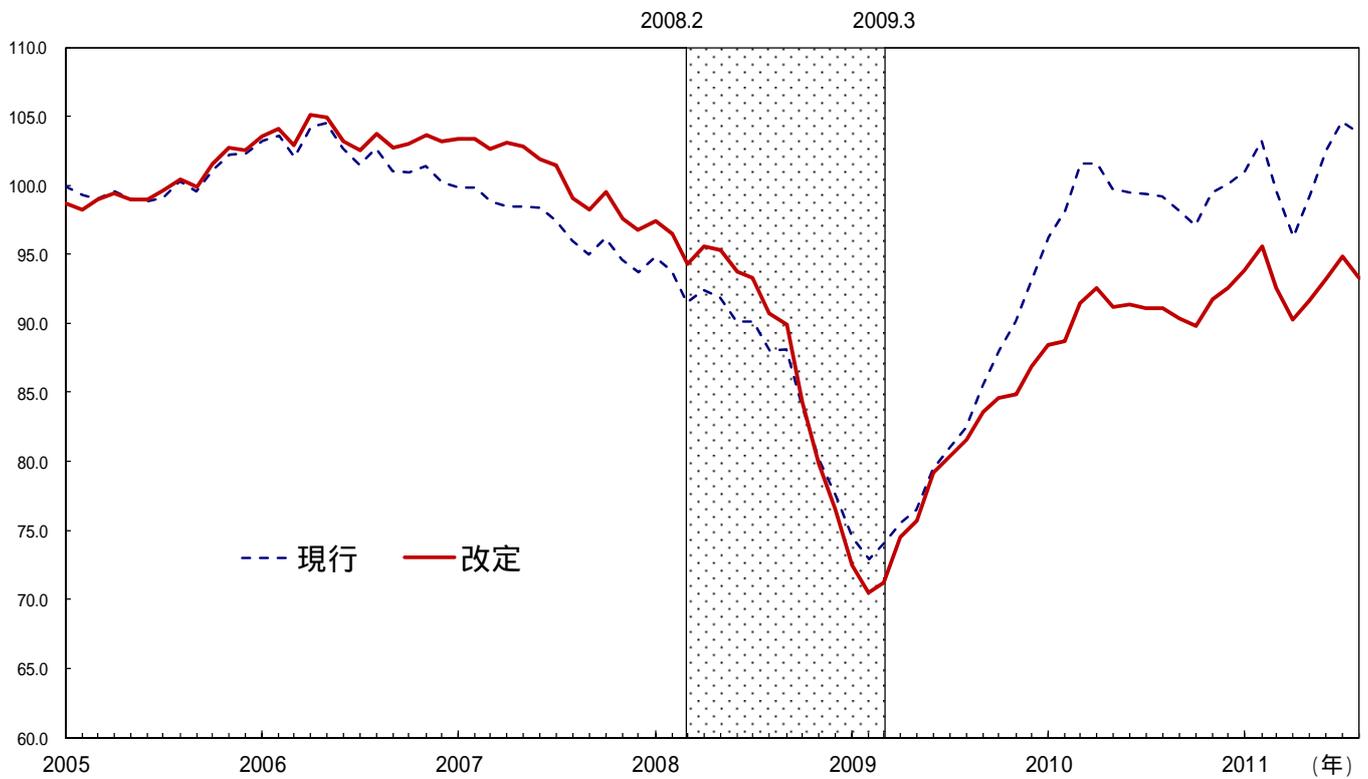
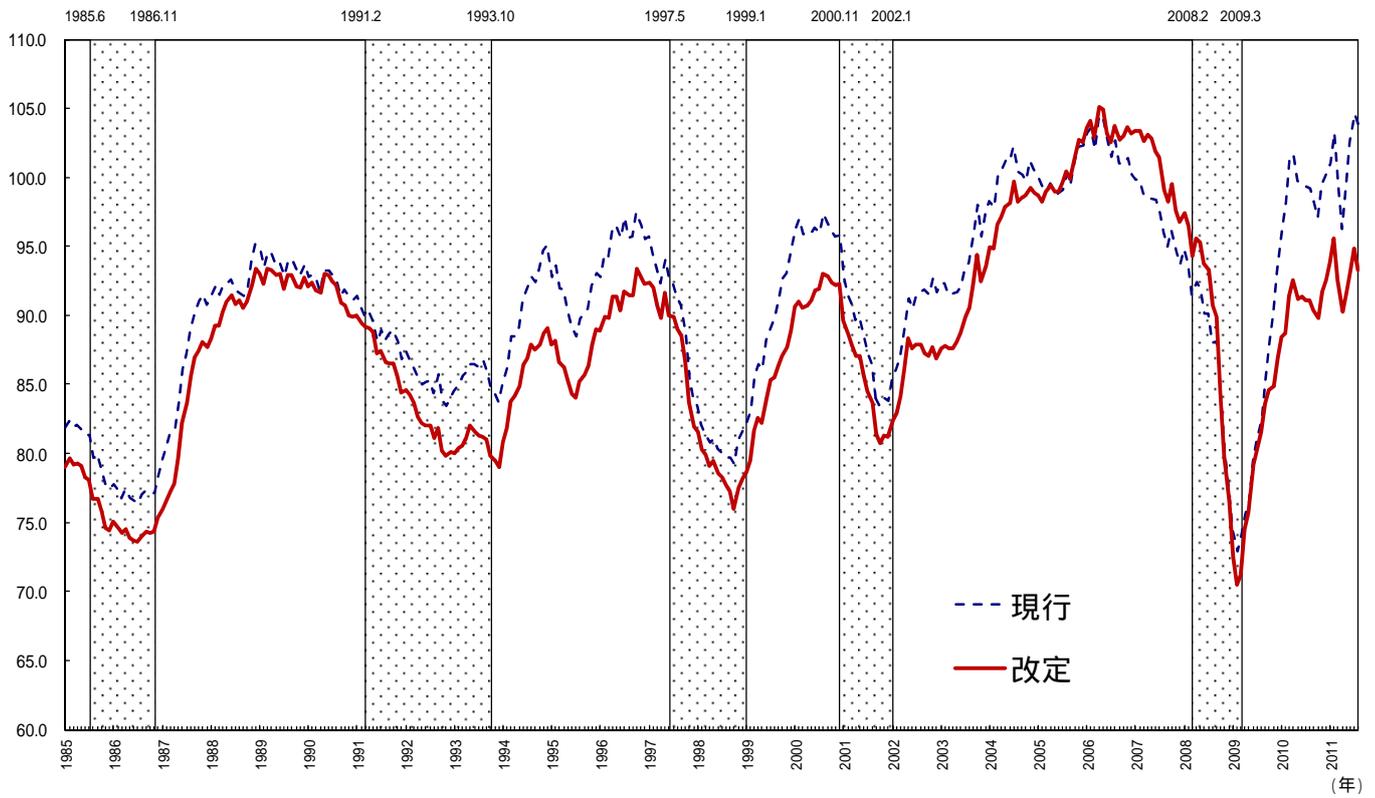
CI		タイミング						不規則 変動
		山						
		1985.6	1991.2	1997.5	2000.11	2008.2	平均	
先行系列	新CI	-	-26	-7	-3	-22	-14.5	48
	現行CI	-	-26	-7	-3	-21	-14.3	65
一致系列	新CI	-	-4	-2	1	-8	-3.3	28
	現行CI	-	-4	0	1	-6	-2.3	27
遅行系列	新CI	6	-12	4	3	-7	-1.2	35
	現行CI	2	-11	4	3	-13	-3.0	32
		谷						
		1986.11	1993.1	1999.1	2002.1	2009.3	平均	
先行系列	新CI	-4	2	-3	-3	-1	-1.8	8
	現行CI	-4	-11	-3	-3	-1	-4.4	11
一致系列	新CI	-3	2	-1	-1	0	-0.6	5
	現行CI	0	2	-1	0	0	0.2	3
遅行系列	新CI	1	8	5	4	8	5.2	6
	現行CI	3	8	5	4	8	5.6	3

DI		タイミング						不規則 変動	平滑度
		山							
		1985.6	1991.2	1997.5	2000.11	2008.2	平均		
先行系列	新DI	-3	-7	-3	-2	-20	-7.0	60	1.71
	現行DI	-13	-8	-4	-2	-21	-9.6	58	1.79
一致系列	新DI	1	-1	0	1	-2	-0.2	40	2.56
	現行DI	0	-1	0	1	-2	-0.4	42	2.57
遅行系列	新DI	4	4	5	1	-2	2.4	38	2.13
	現行DI	4	3	4	3	-2	2.4	35	2.13
		谷							
		1986.11	1993.1	1999.1	2002.1	2009.3	平均		
先行系列	新DI	-4	3	-3	-1	1	-0.8	10	
	現行DI	-3	0	-3	-1	1	-1.2	5	
一致系列	新DI	-1	12	-1	0	2	2.4	5	
	現行DI	0	12	0	0	1	2.6	3	
遅行系列	新DI	-5	17	8	13	8	8.2	11	
	現行DI	1	17	7	5	7	7.4	8	

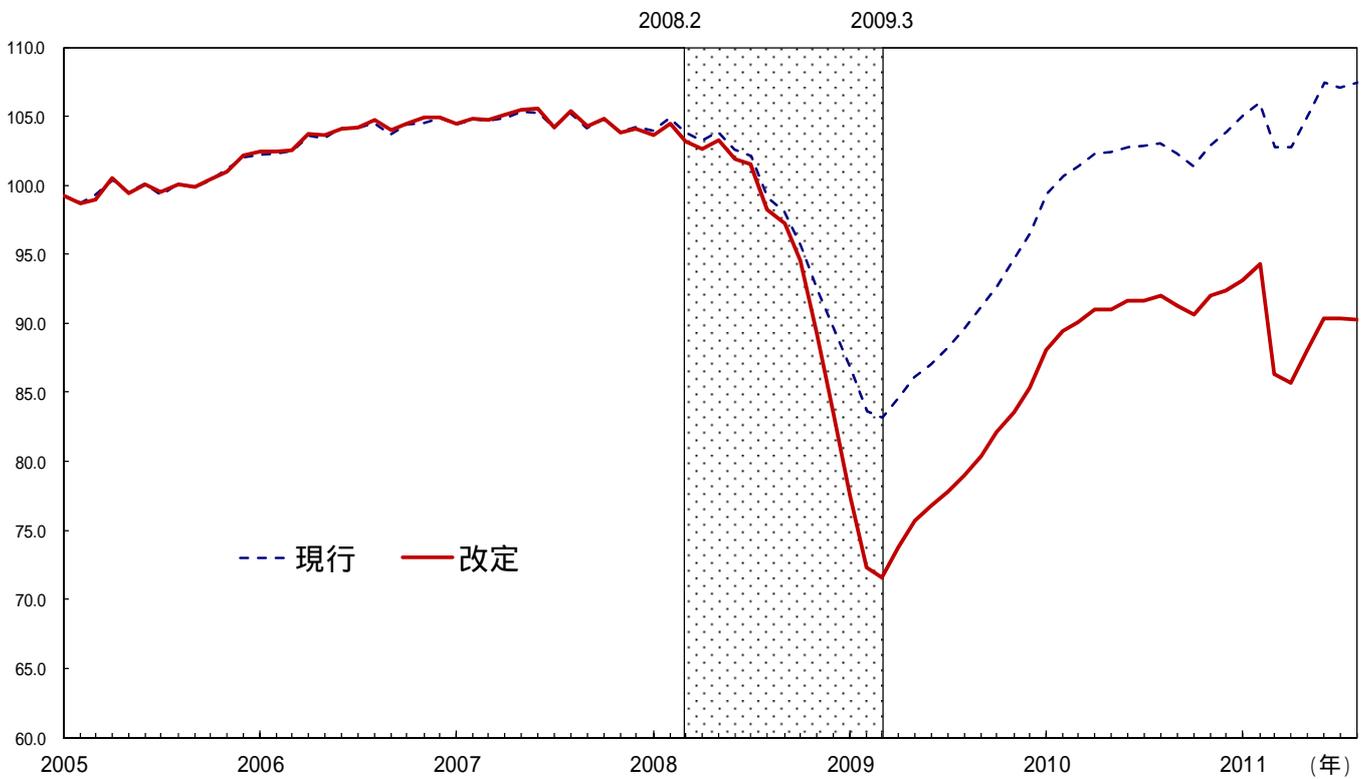
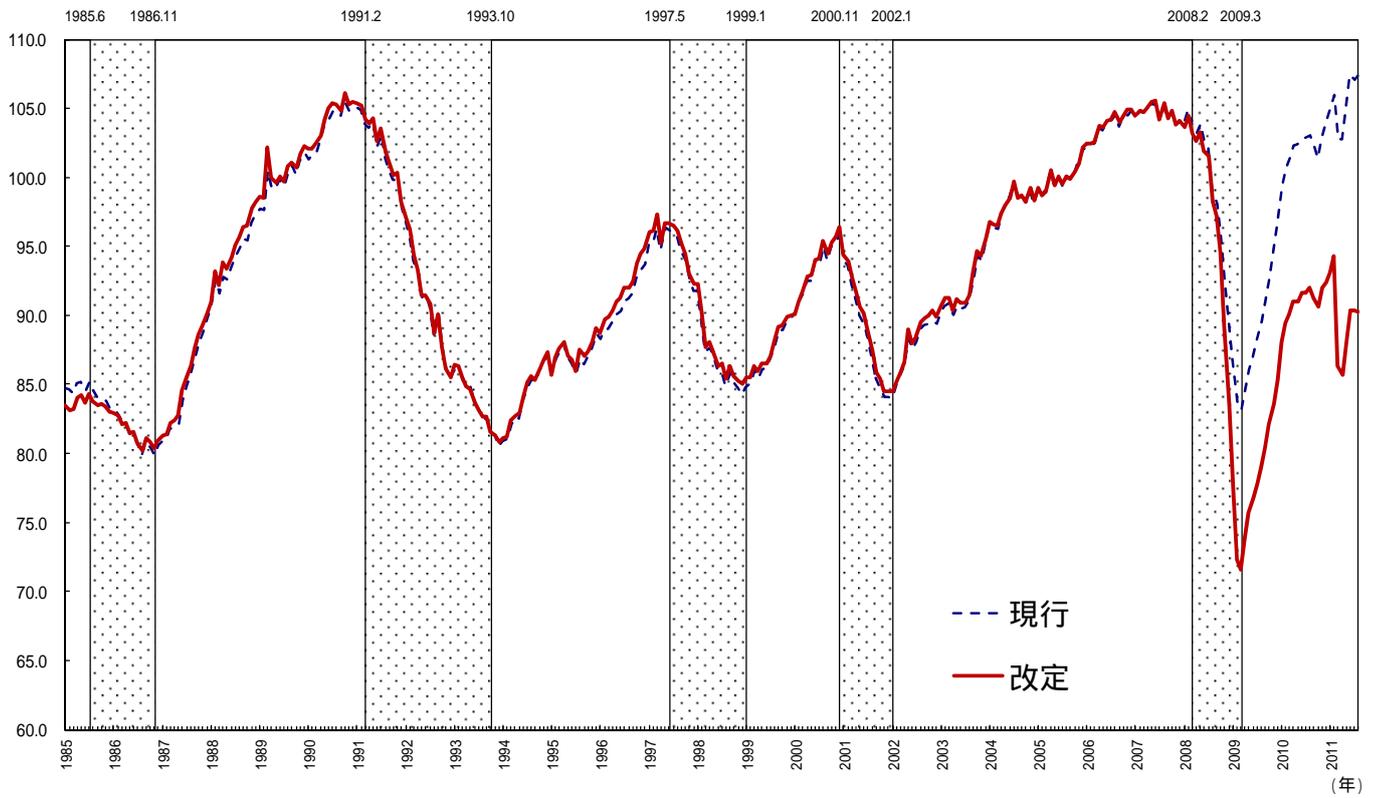
1. タイミングのマイナスは先行、プラスは遅行を表す。
2. DIのタイミングの判定は5項反復移動平均値が50を上回り(下回り)は始める直前の月を指数の谷(山)として計算した。
3. CIのタイミングの判定はブライ=ボッシュン法による。
4. DIにおける不規則変動は、後退(拡張)期間において、一時的に50%を上回る(下回る)動きをいう。  
一方CIにおける不規則変動は、後退(拡張)期間において、3ヶ月移動平均値が前月より上昇(低下)している動きをいう。  
なお、不規則変動を測定する際、先行指数については後退(拡張)期間を6ヶ月基準日付より前倒し、遅行系列については後ろ倒ししている。
5. 平滑度の指標としては、系列の二階階差を用いており、値が小さいほど平滑であることを示す。  
平滑度 = (二階階差)<sup>2.05</sup> / 月数(1985年1月~2011年5月)
6. 上記の数値は2011年7月分までのデータで計算している。

(資料 2-10) 新旧 CI の対比グラフ (上段:長期 下段:短期)

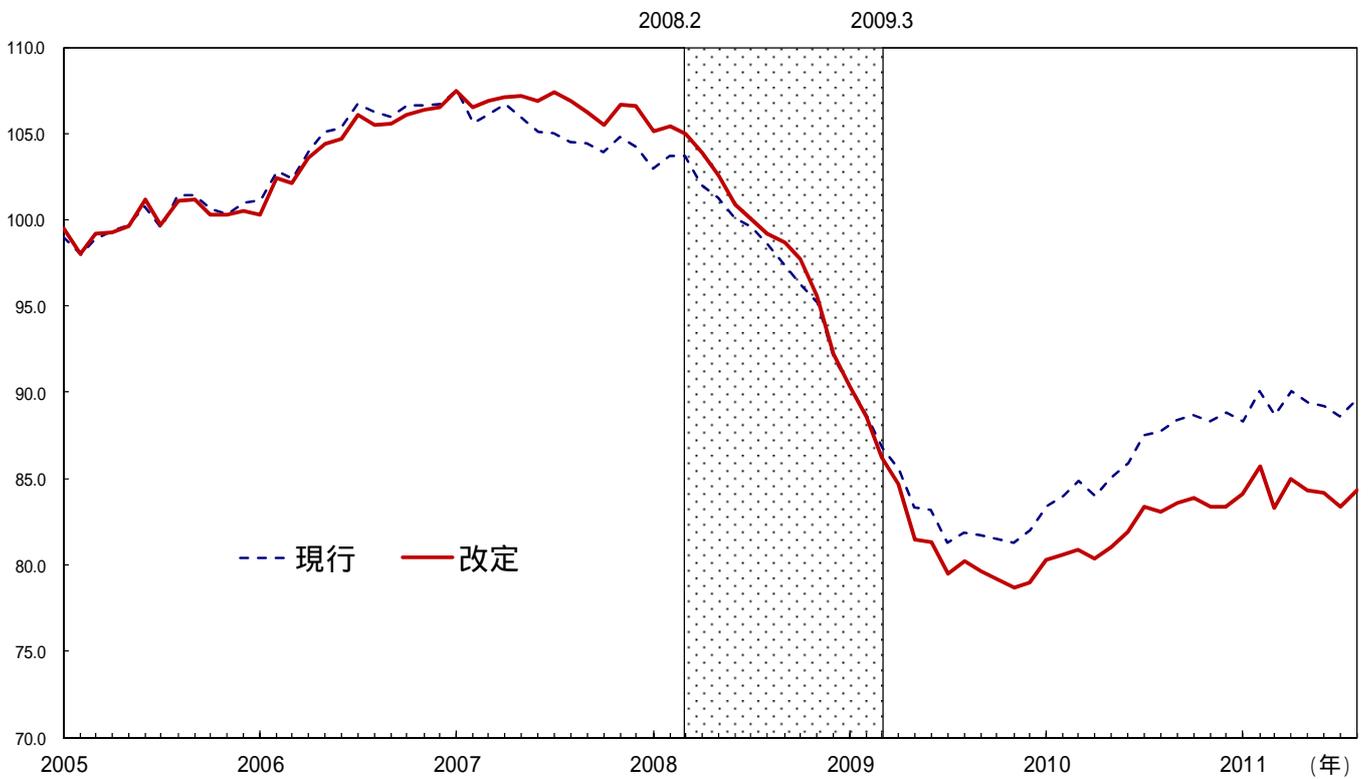
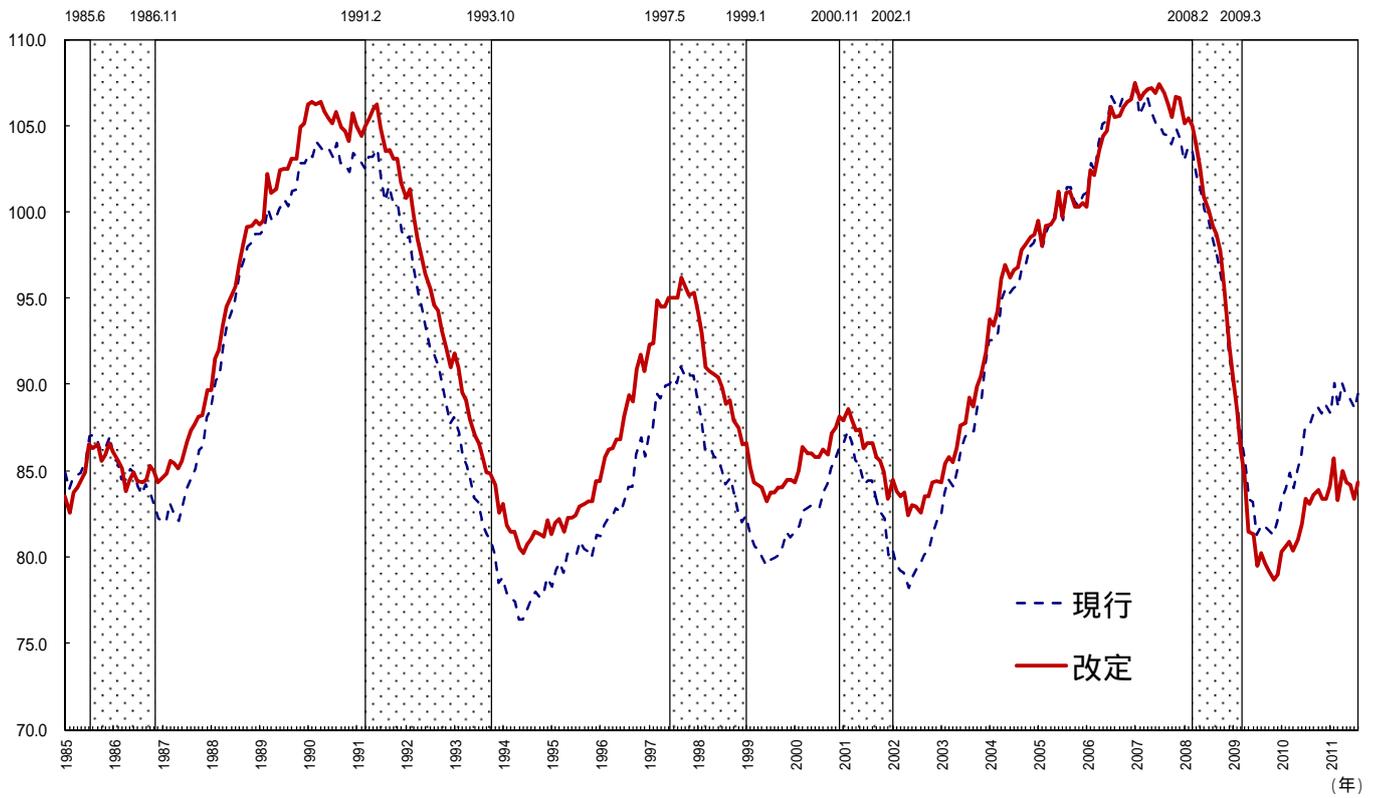
1. CI 先行指数



## 2. CI 一致指数

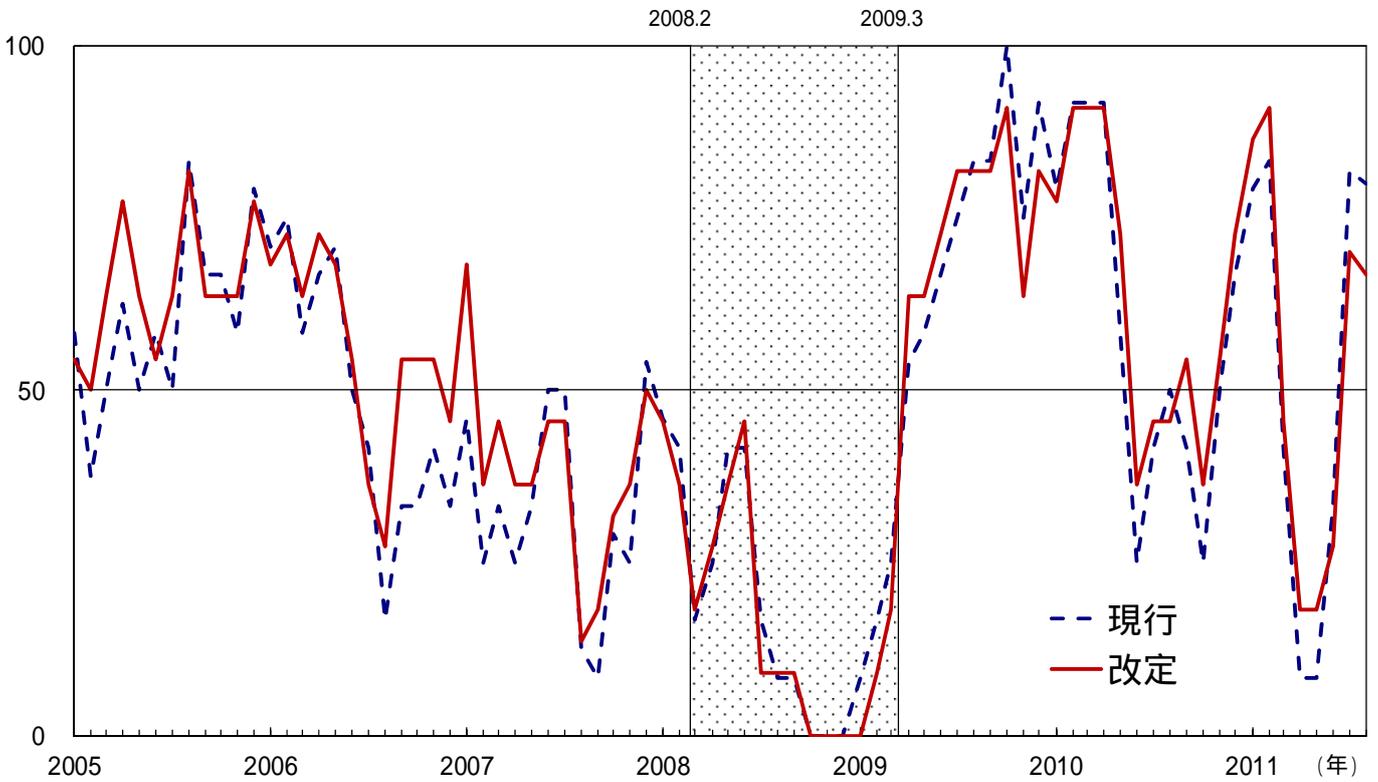
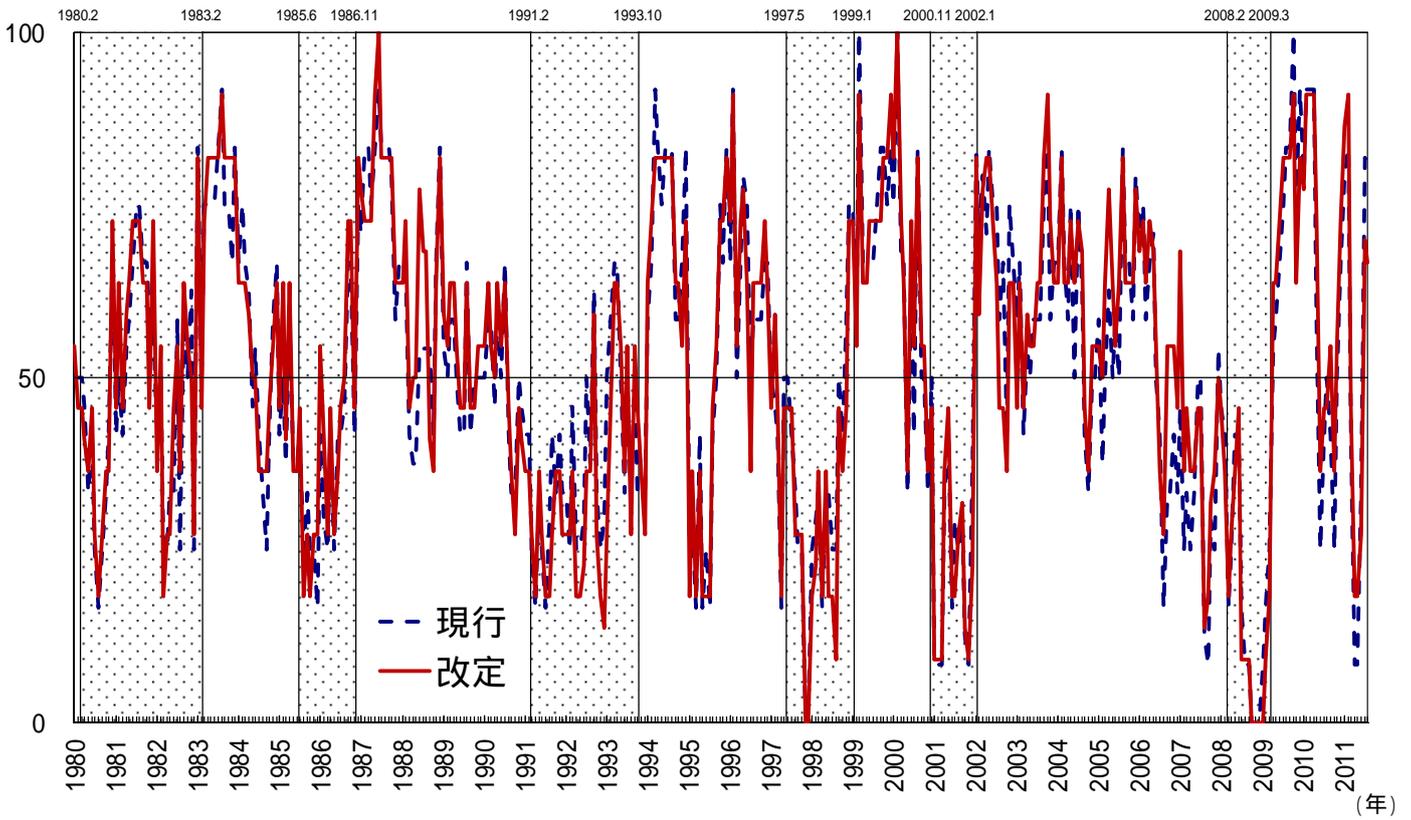


### 3 . CI 遅行指数

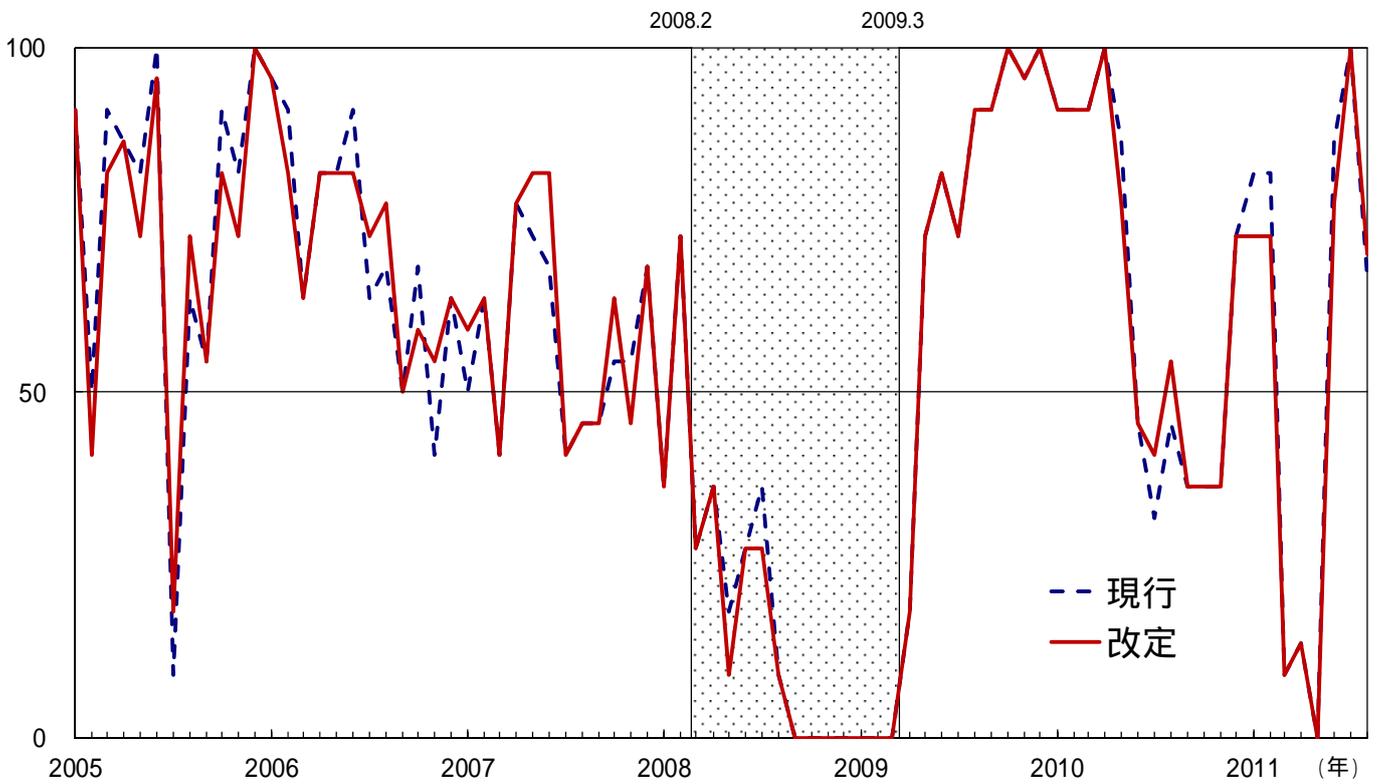
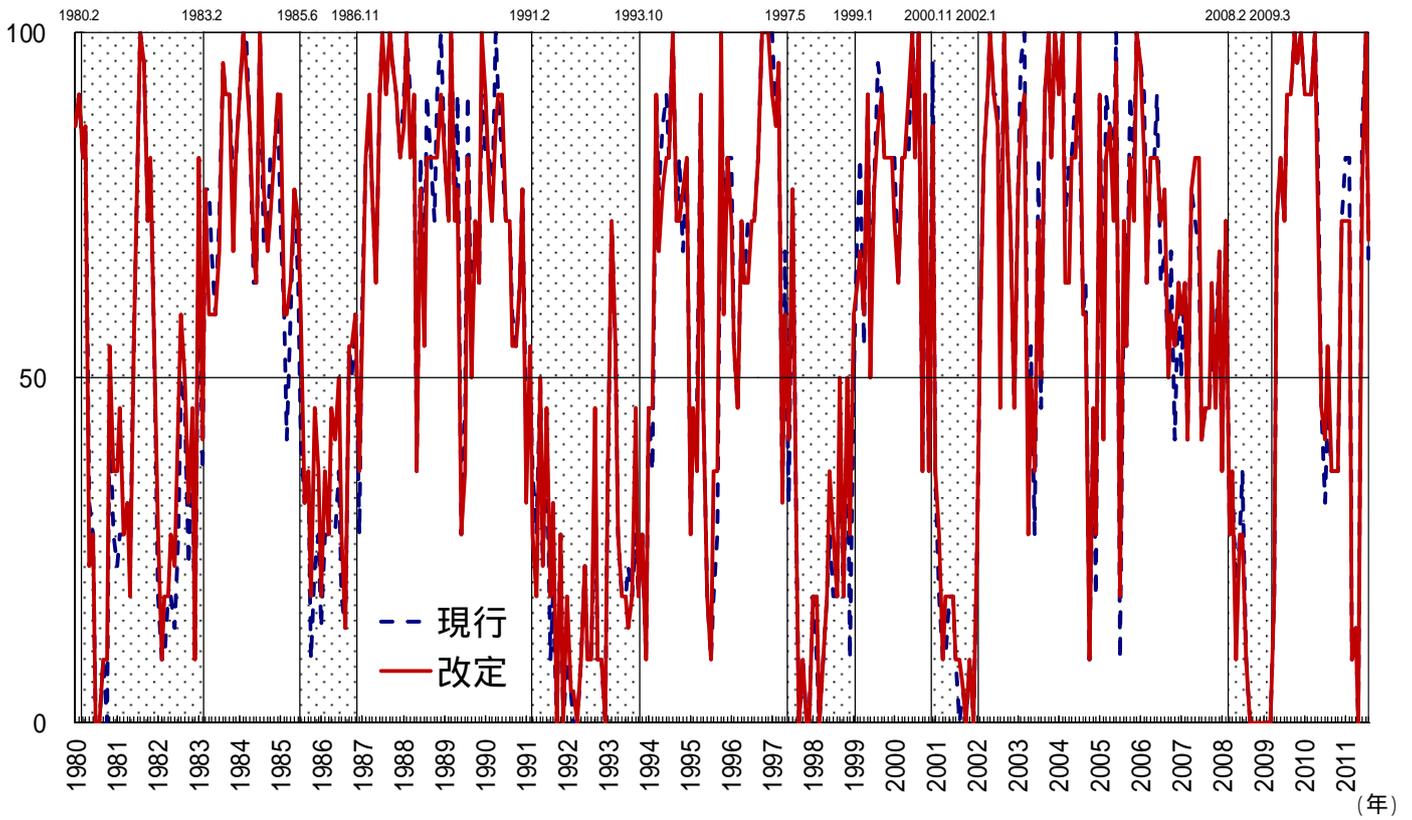


(資料 2-11) 新旧 DI の対比グラフ (上段:長期 下段:短期)

1. DI 先行指数



## 2. DI 一致指数



### 3. DI 遅行指数

