

(資料2 - 9) 新旧CIとDIのパフォーマンス

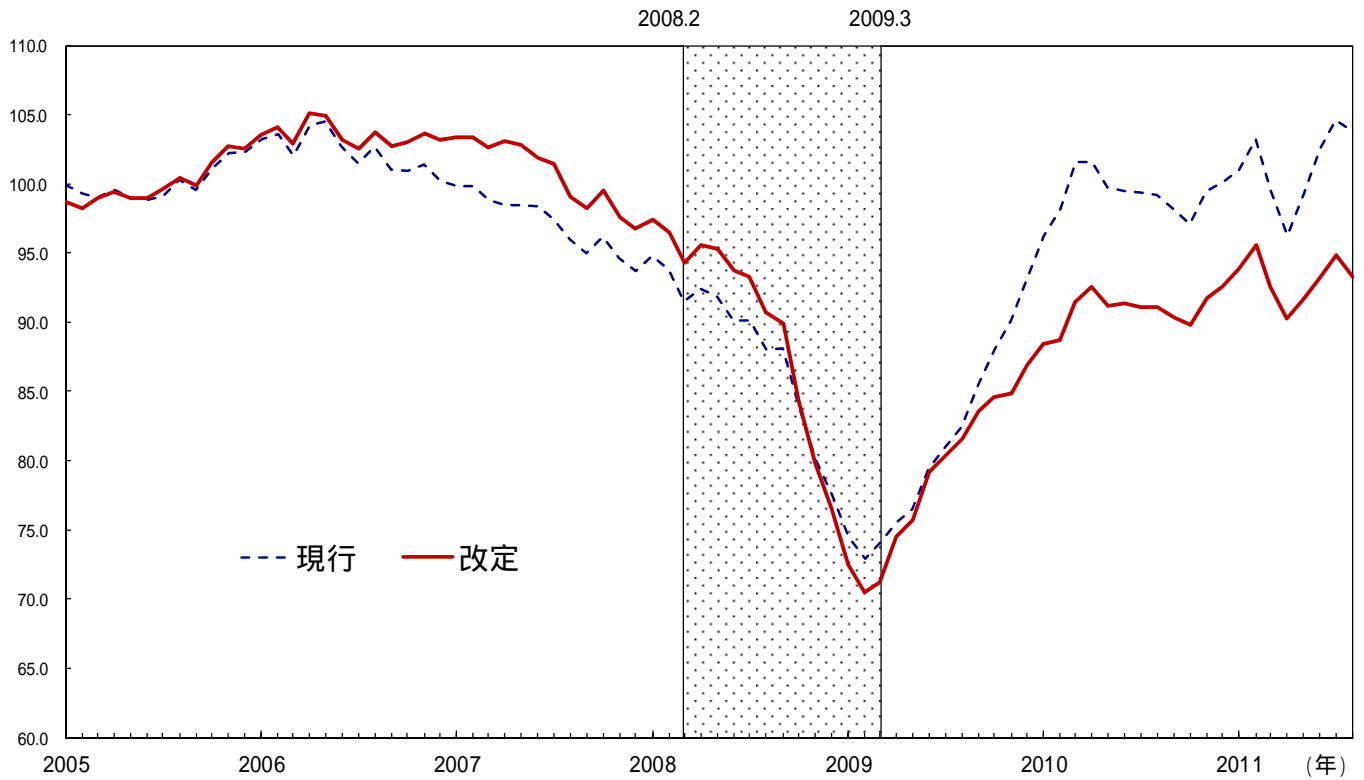
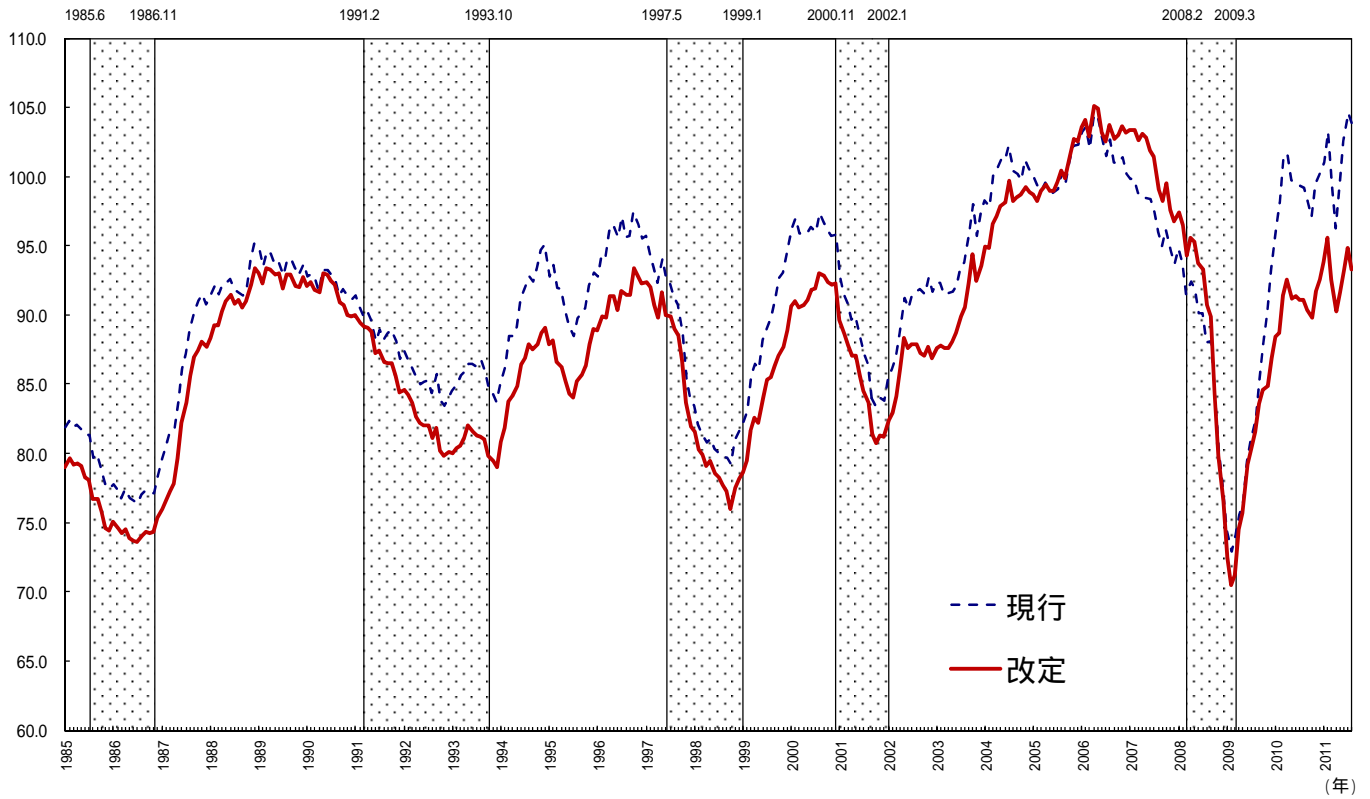
| CI | | タイミング | | | | | | 不規則変動 |
|------|------|---------|--------|--------|---------|--------|-------|-------|
| | | 山 | | | | | | |
| | | 1985.6 | 1991.2 | 1997.5 | 2000.11 | 2008.2 | 平均 | |
| 先行系列 | 新CI | - | -26 | -7 | -3 | -22 | -14.5 | 48 |
| | 現行CI | - | -26 | -7 | -3 | -21 | -14.3 | 65 |
| 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 | | | | | | |
| | | 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 | | | | | | | |
| | | 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 | |

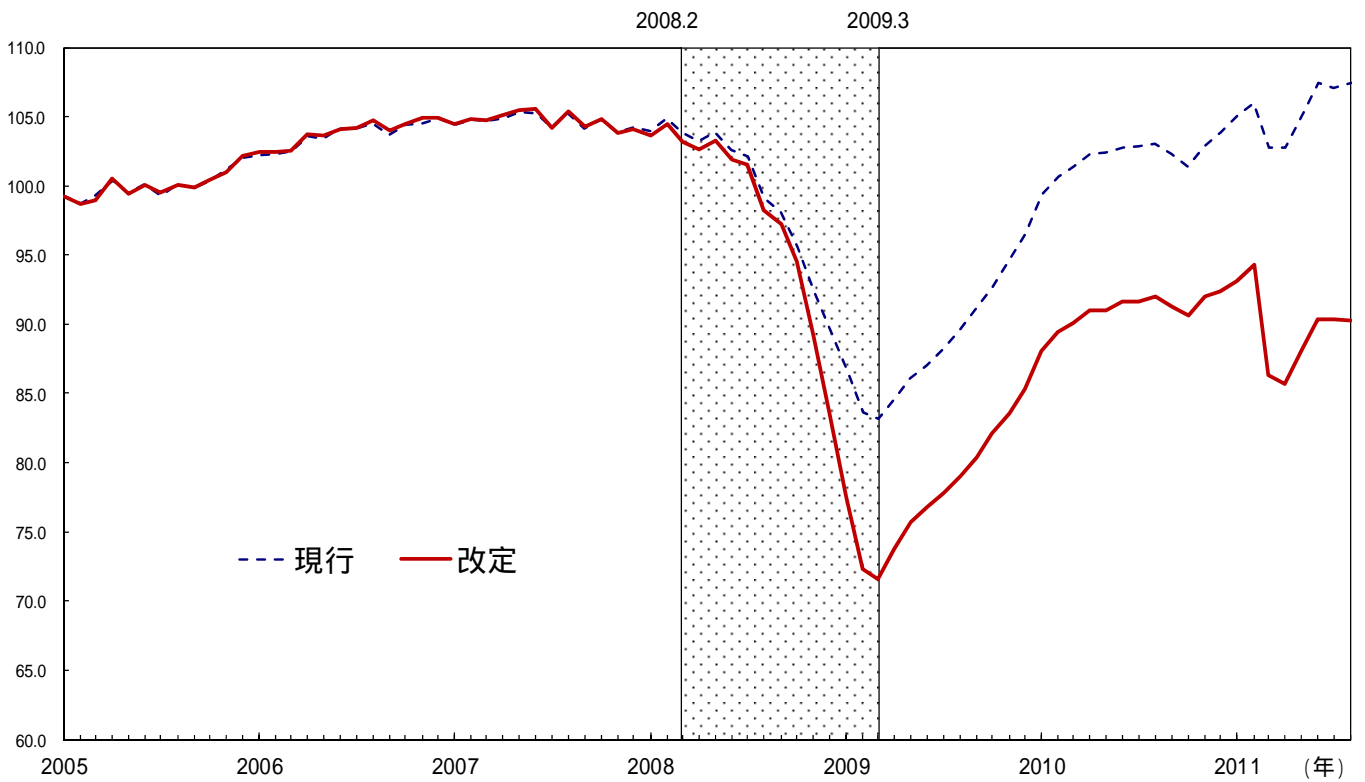
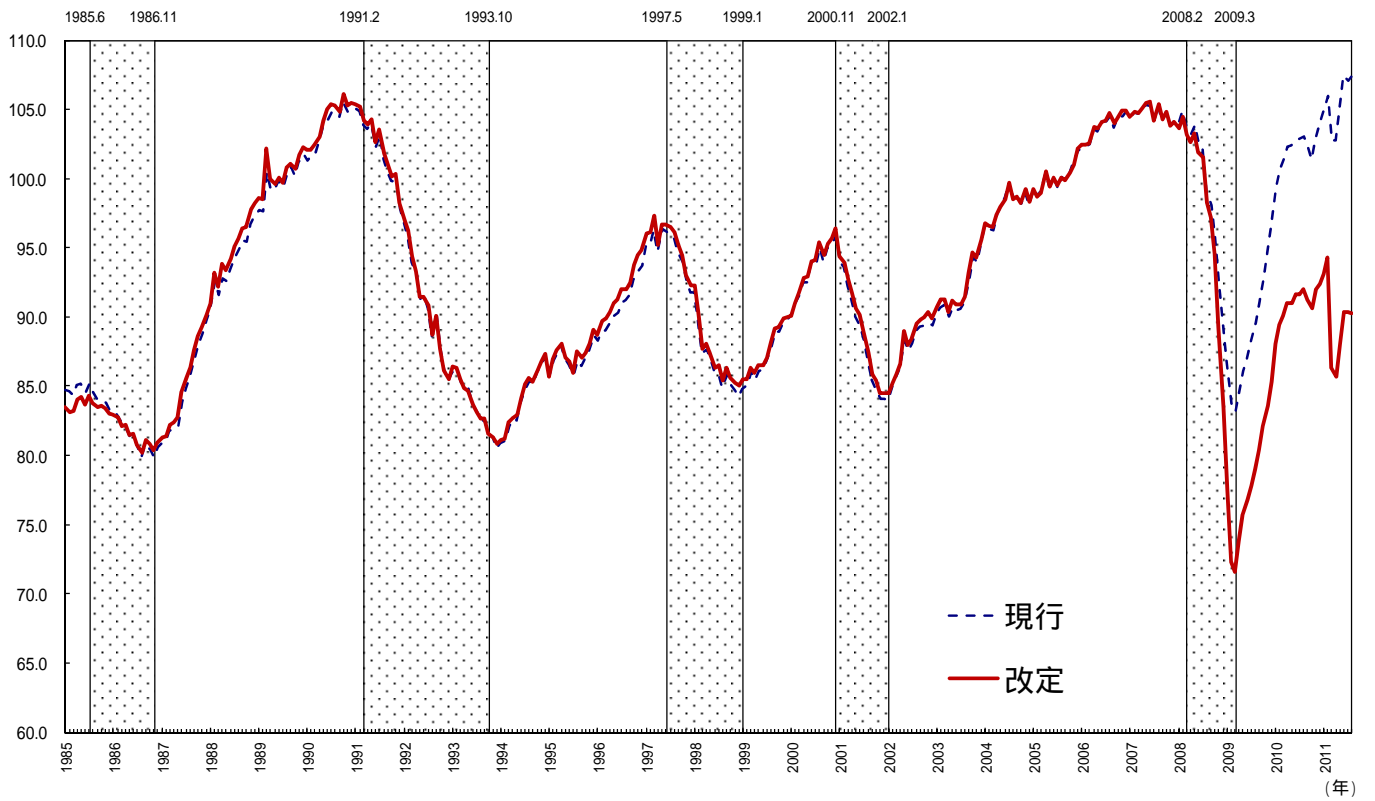
1. タイミングのマイナスは先行、プラスは遅行を表す。
2. DIのタイミングの判定は5項反復移動平均値が50を上回り(下回り)は始める直前の月を指数の谷(山)として計算した。
3. CIのタイミングの判定はブライ=ボッシュン法による。
4. DIにおける不規則変動は、後退(拡張)期間において、一時的に50%を上回る(下回る)動きをいう。
一方CIにおける不規則変動は、後退(拡張)期間において、3ヶ月移動平均値が前月より上昇(低下)している動きをいう。
なお、不規則変動を測定する際、先行指数については後退(拡張)期間を6ヶ月基準日付より前倒し、遅行系列については後ろ倒ししている。
5. 平滑度の指標としては、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。
$$\text{平滑度} = (\text{二階階差})^{2.05} / \text{月数}(1985年1月 \sim 2011年5月)$$
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)

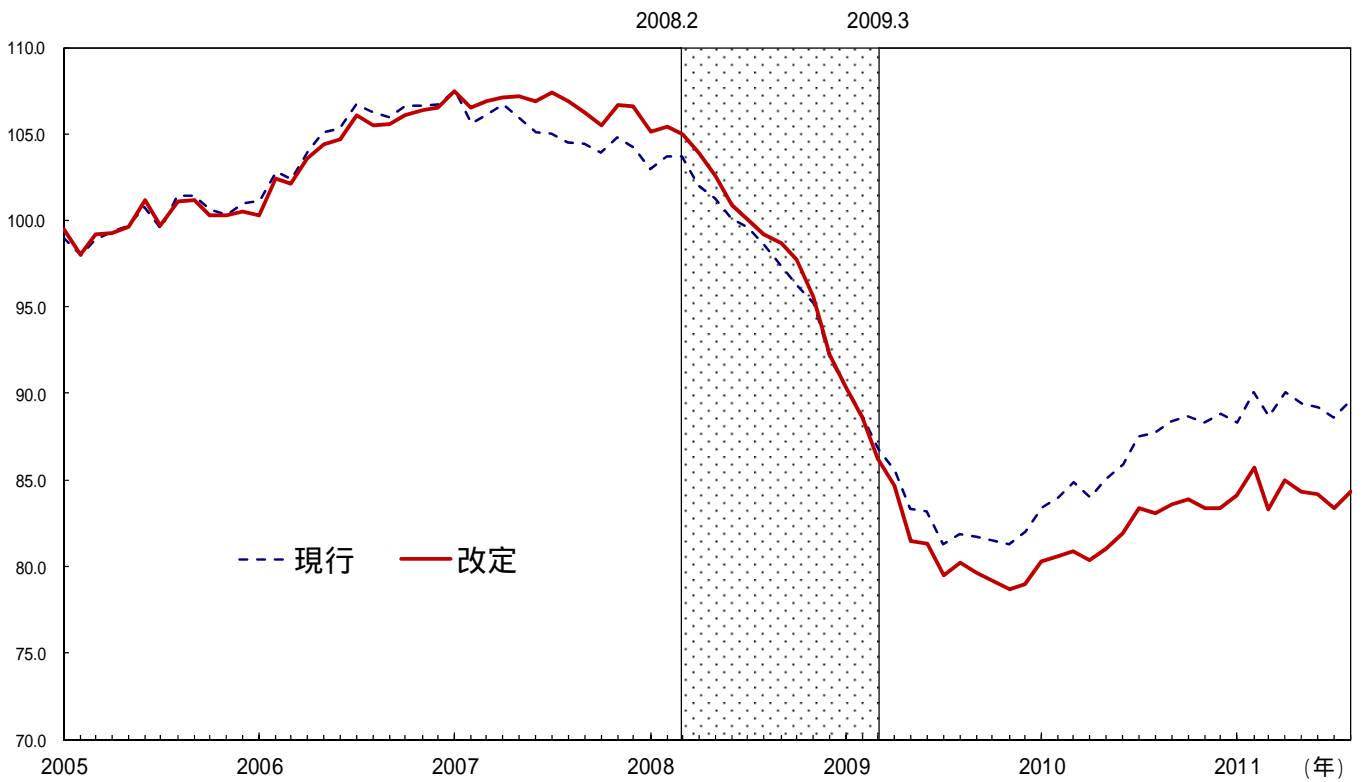
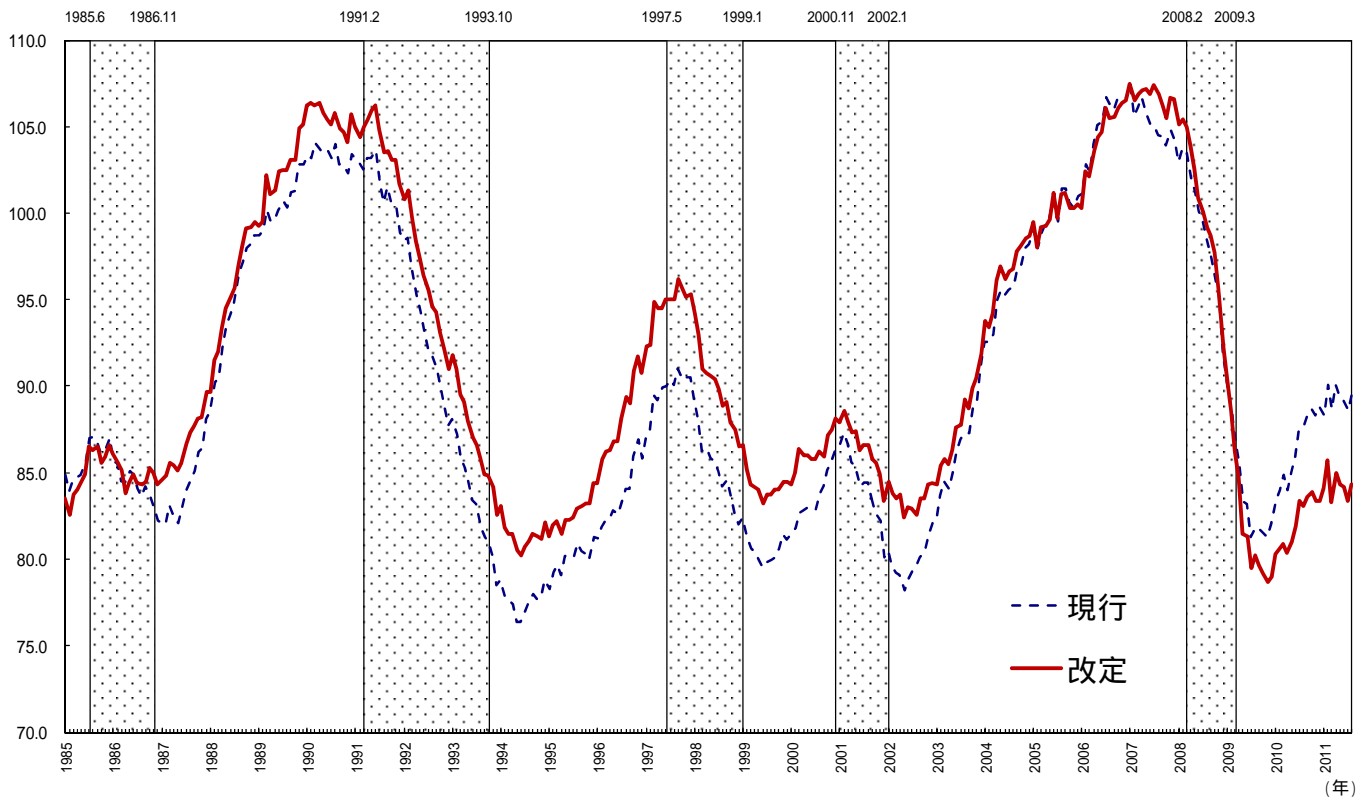
1. CI 先行指数



2. CI 一致指数

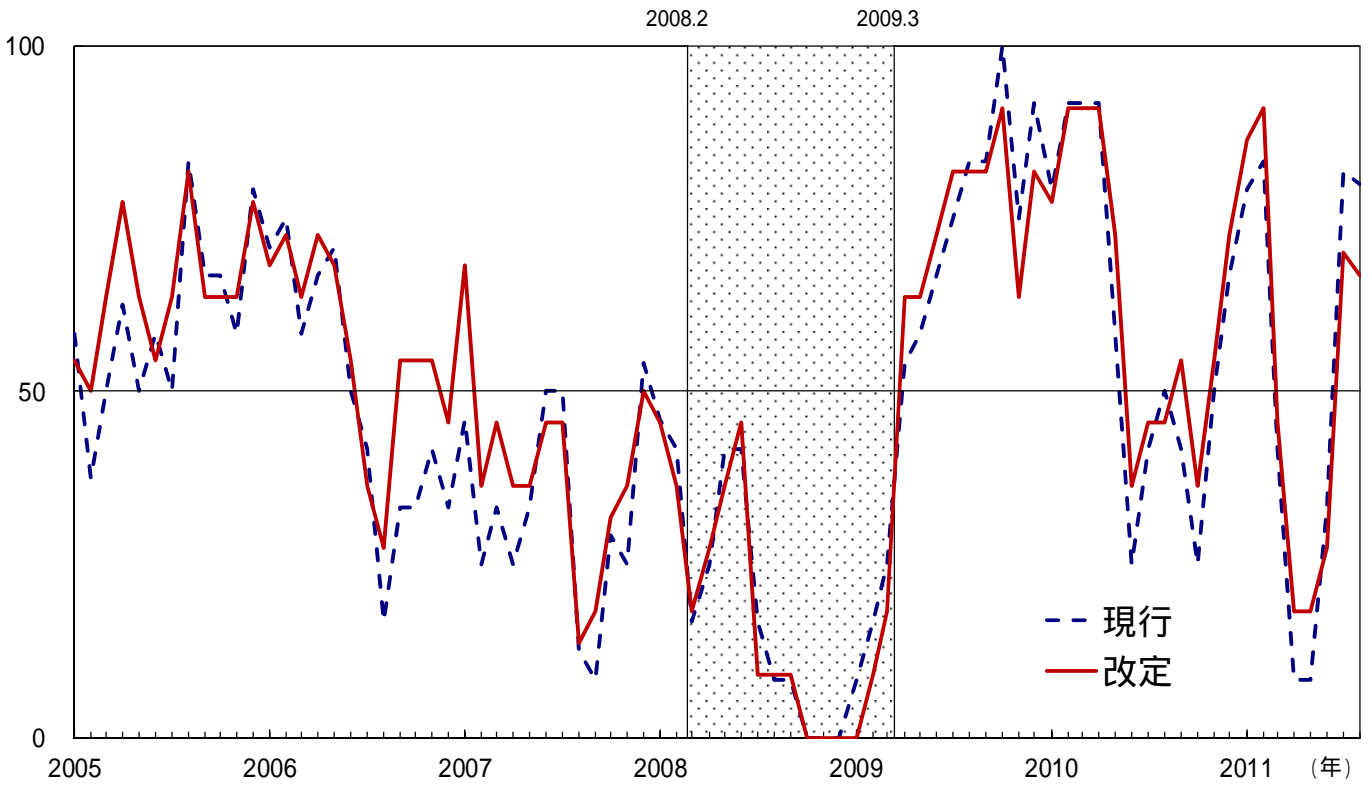
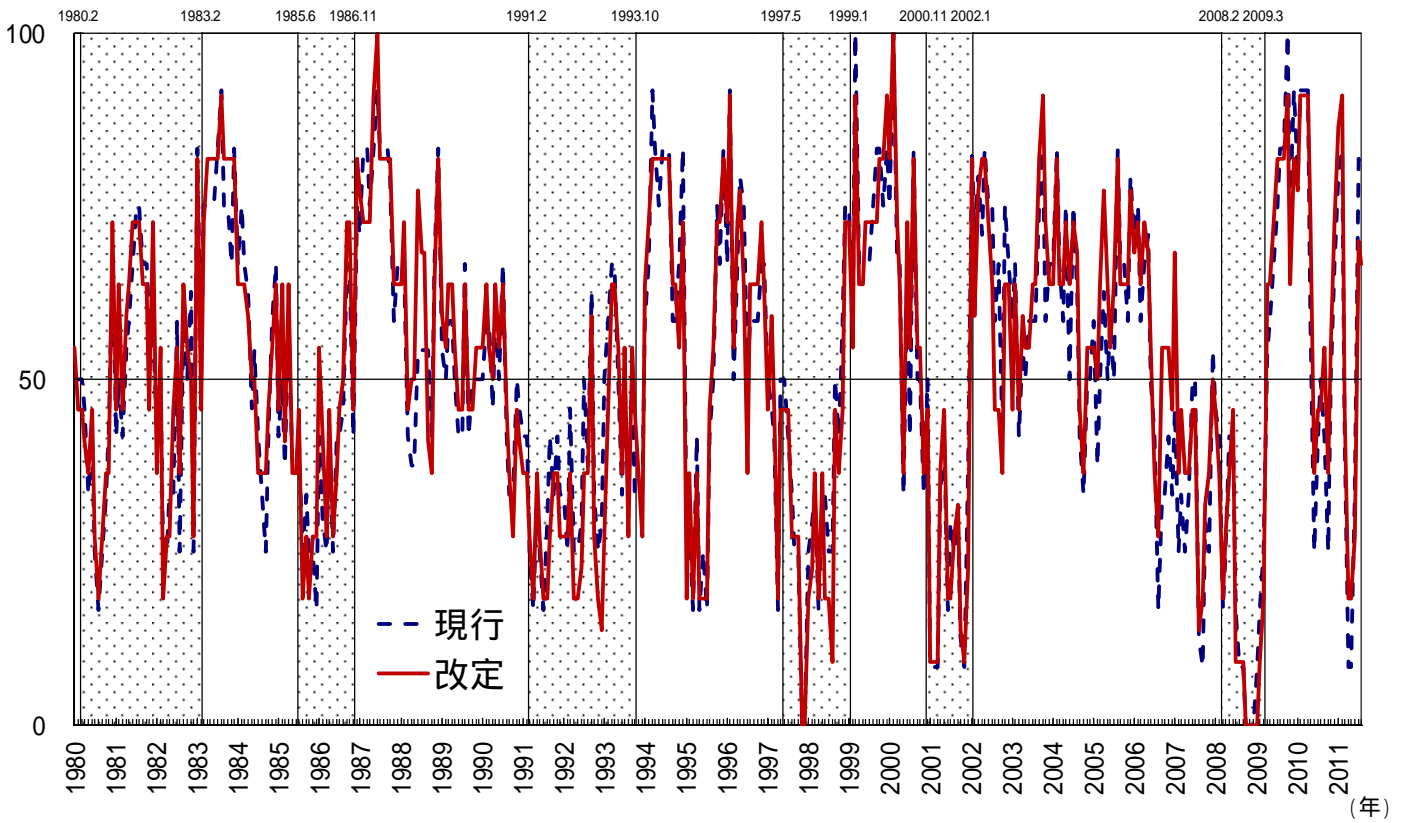


3 . CI 遅行指数

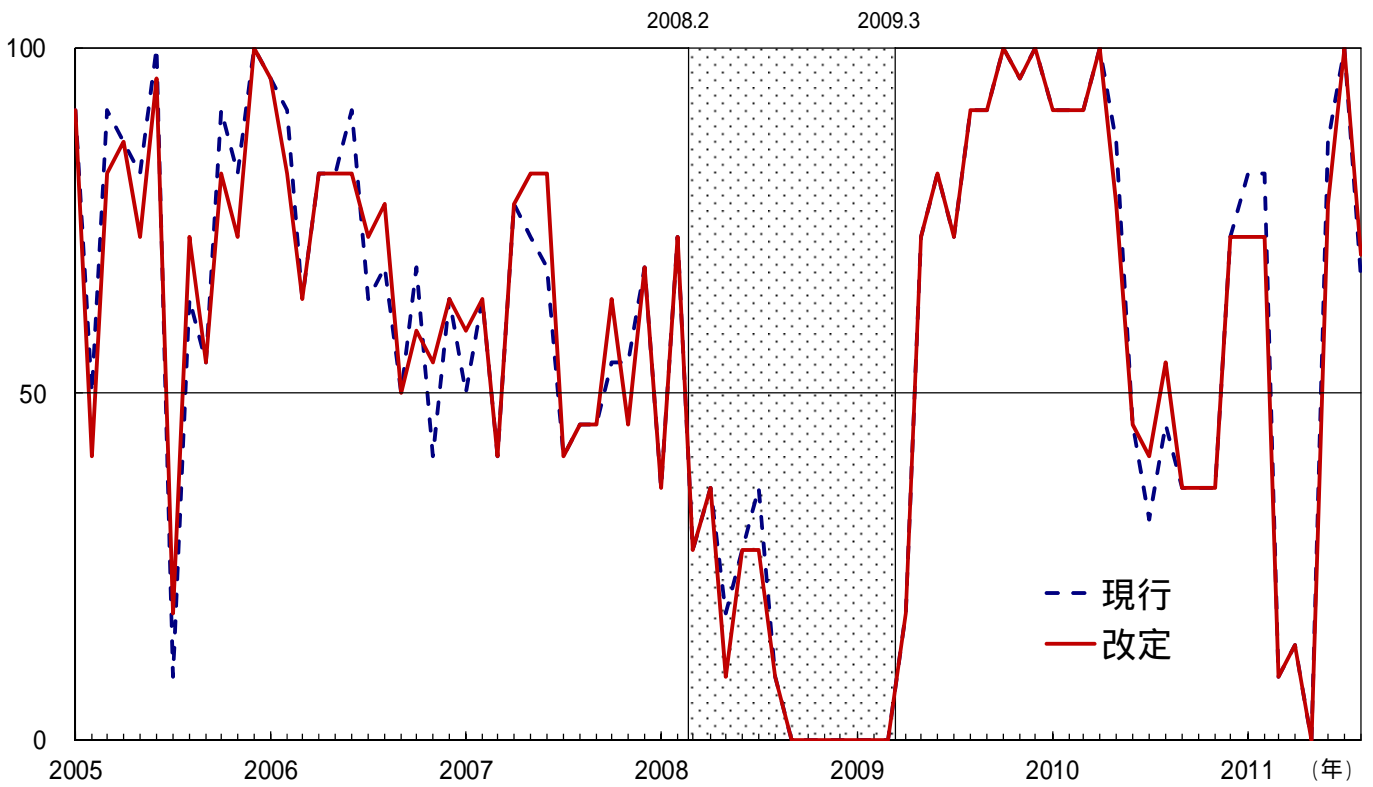
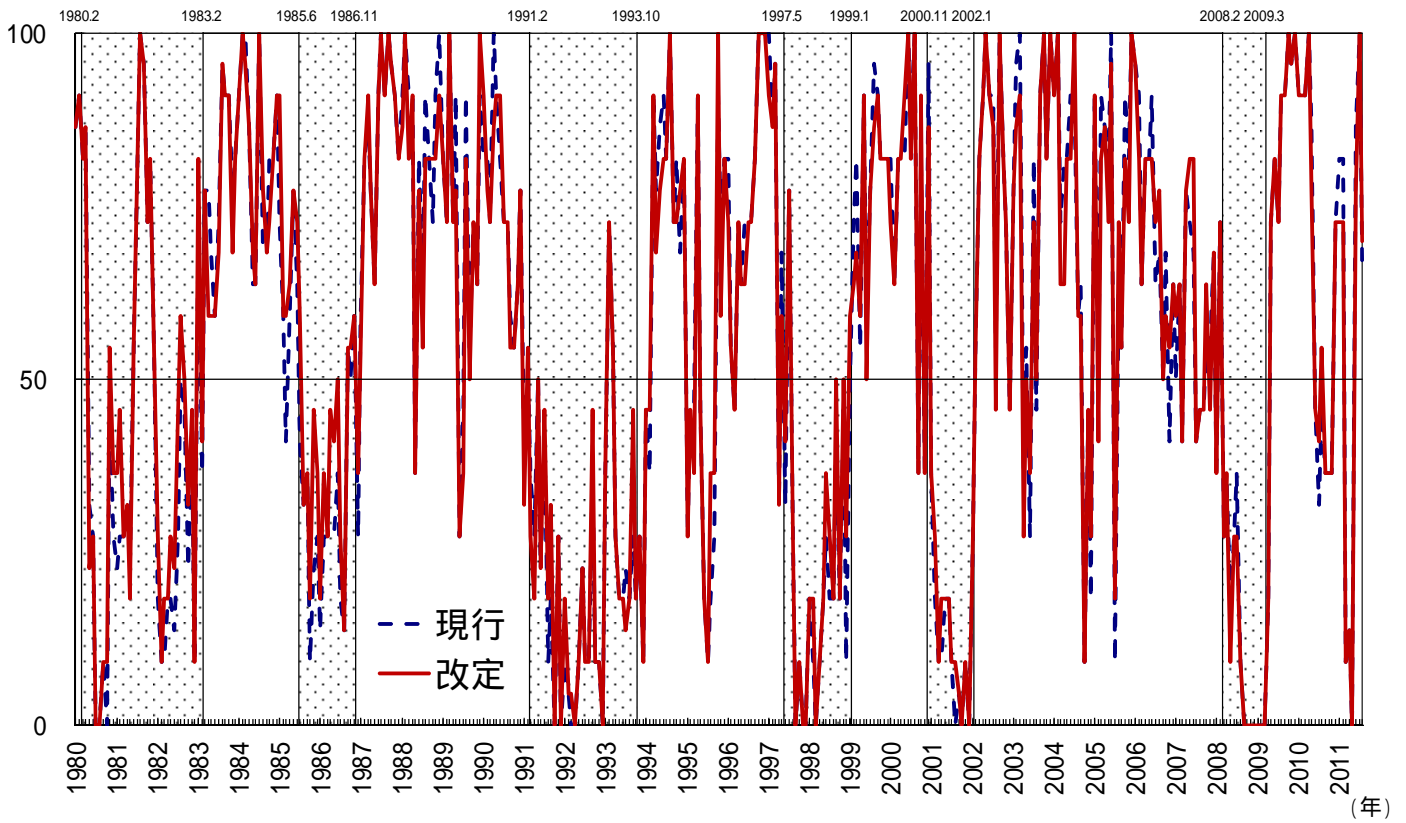


(資料 2-11) 新旧 DI の対比グラフ (上段:長期 下段:短期)

1. DI 先行指数



2. DI 一致指数



3. DI 遅行指数

