

表 「製造業（船舶を除く）」のスペック概要

系列名	製造業 (船舶を除く)
データ期間	2005 年 4 月～2022 年 12 月
データ加工	対数変換あり
曜日調整・異常値等 (注 1)、(注 2)	2曜日型曜日調整 日本型曜日調整2 異常値(LS2008.11, LS2009.1)
ARIMA モデル(注 1)	(0 1 1) (0 1 1)
X11 パートの設定 (注 3)	①モデルのタイプ: 乗法型 ②移動平均項数: seasonalma=MSR(3×5 が選 定) ③ヘンダーソン移動平均項 数: 13 項 ④特異項の管理限界: 下限 1.5 σ 上限 2.5 σ
その他(注4)	予測期間は 12 か月

(注)

1. 曜日調整（以下「調整」という。）の適否判断と ARIMA モデルの選定については、次の通り行っている。まず、調整の有無の組み合わせごとに、X-12-ARIMA のモデル選定機能（automdl コマンド）を用いて ARIMA モデルの階差及び次数を選定し採用候補を作成する。次に、候補の中から、調整の統計的な妥当性を検証の上、AIC が一番小さい候補を採用する。なお、調整には以下のパターンが設定されている。また、うるう年調整は行っていない。

①標準曜日調整・・・毎月の月曜日から日曜日までの各曜日の数が月によって違うことにより原数値に与えている影響を、毎月の各曜日の数を説明変数として取り除くもの。

②2曜日型曜日調整・・・毎月の月曜日から日曜日までの各曜日の数が月によって違うことにより原数値に与えている影響を、毎月の平日（月曜日～金曜日）の数の合計と休日（土曜日と日曜日）の数の合計の2つを説明変数として取り除くもの。

③日本型曜日調整1・・・日本の国民の祝日を考慮したもの。

④日本型曜日調整2・・・日本の国民の祝日及びお盆休みや年末年始などの慣例的な休日を考慮したもの。

⑤うるう年調整・・・うるう年による2月の日数の変動を考慮したもの。

2. 異常値検出は、X-12-ARIMA の outlier コマンドを用いている。

3. X11 パートの設定項目のうち②及び③は X11 コマンドによる選定結果を用いている。

4. 予測期間は MAPR が最小となるものを選択。