

参考系列のスペック概要一覧（昭和62年4月～平成17年3月）

(1) 受注総額（モデル推定期間：昭和62年4月～平成27年12月）	
データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	2曜日型曜日調整、日本型曜日調整2、 LS2008. Oct、LS2009. Jan、A02014. Apr
ARIMAモデル (注4)	(2 1 2) (2 1 1)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ：乗法型 ② 移動平均項数：seasonal _{ma} =MSR (3×5) 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 1.5σ 上限 2.5σ
その他	最小改訂率（前月比）はMaxlead=1の2.66

(注)

1. 階差及び対数変換の可否については、X-12-ARIMAの自動判定結果を参考に総合的に判断する。
2. 各種曜日調整の適否判定は、推定パラメタのt値等を参考に総合的に判断する。なお、以下の5パターンが設定されている。
 - 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。
3. 異常値検出は、X-12-ARIMAのoutlierコマンドを用いている。
4. ARIMAモデルの次数選定は、X-12-ARIMAのモデル選定機能等を利用する。
5. X-11パートの設定項目は、総務省「季節調整法に関する各省庁からの報告取りまとめ」に準拠している。

(2) 民需（モデル推定期間：昭和62年4月～平成27年12月）	
データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	2曜日型曜日調整、日本型曜日調整2、A01987. Jun
ARIMAモデル (注4)	(2 1 2) (0 1 2)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ：乗法型 ② 移動平均項数：seasonal _{ma} =MSR (3×5) ③ ヘンダーソン移動平均項数：23項 ④ 特異項の管理限界：下限 1.5σ 上限 2.5σ
その他	最小改訂率（前月比）はMaxlead=1の2.86

(注) 1～5. (1)に同じ。

(3) 民需(除船電)(モデル推定期間:昭和62年4月~平成27年12月)

データ加工(注1)	対数変換
曜日調整(注2)、異常値等(注3)	2曜日型曜日調整、日本型曜日調整1、 LS2008. Nov
ARIMAモデル(注4)	(2 1 2)(2 1 2)
X-11パートの設定(注5)	① モデルのタイプ:乗法型 ② 移動平均項数:seasonal $\text{ma}=\text{MSR}$ (3×5) 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	最小改訂率(前月比)はMaxlead=0の2.56

(注) 1~5. (1)に同じ。

(4) 製造業(モデル推定期間:昭和62年4月~平成27年12月)

データ加工(注1)	対数変換
曜日調整(注2)、異常値等(注3)	2曜日型曜日調整、LS2008. Nov、LS2009. Jan
ARIMAモデル(注4)	(2 1 2)(1 1 1)
X-11パートの設定(注5)	① モデルのタイプ:乗法型 ② 移動平均項数:seasonal $\text{ma}=\text{MSR}$ (3×5) 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	最小改訂率(前月比)はMaxlead=1の2.90

(注) 1~5. (1)に同じ。

(5) 非製造業(モデル推定期間:昭和62年4月~平成27年12月)

データ加工(注1)	対数変換
曜日調整(注2)、異常値等(注3)	2曜日型曜日調整、日本型曜日調整2 A01987. Jun、A02001. May
ARIMAモデル(注4)	(0 1 1)(0 1 1)
X-11パートの設定(注5)	① モデルのタイプ:乗法型 ② 移動平均項数:seasonal $\text{ma}=\text{MSR}$ (3×5) ③ ヘンダーソン移動平均項数:23項 ④ 特異項の管理限界:下限 1.5 σ 上限 2.5 σ
その他	最小改訂率(前月比)はMaxlead=1の3.66

(注) 1~5. (1)に同じ。

(6) 非製造業 (除船電) (モデル推定期間：昭和62年4月～平成27年12月)

データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	2曜日型曜日調整、日本型曜日調整 2
ARIMAモデル (注4)	(2 1 2) (1 1 2)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ：乗法型 ② 移動平均項数：seasonal $ma=MSR$ (3×5) ③ ヘンダーソン移動平均項数：23項 ④ 特異項の管理限界：下限 1.5 σ 上限 2.5 σ
その他	最小改訂率 (前月比) はMaxlead=0の2.71

(注) 1～5. (1) に同じ。

(7) 官公需 (モデル推定期間：昭和62年4月～平成27年12月)

データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	A01988. Dec、TC1991. Nov、A01992. Jun、A01993. Jun
ARIMAモデル (注4)	(1 0 2) (0 1 1)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ：乗法型 ② 移動平均項数：seasonal $ma=MSR$ (3×5) ③ ヘンダーソン移動平均項数：23項 ④ 特異項の管理限界：下限 1.5 σ 上限 2.5 σ
その他	最小改訂率 (前月比) はMaxlead=2の4.95

(注) 1～5. (1) に同じ。

(8) 外需 (モデル推定期間：昭和62年4月～平成27年12月)

データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	TC2008. Oct、LS2009. Jan
ARIMAモデル (注4)	(0 1 1) (0 1 1)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ：乗法型 ② 移動平均項数：seasonal $ma=MSR$ (3×5) ③ ヘンダーソン移動平均項数：23項 ④ 特異項の管理限界：下限 1.5 σ 上限 2.5 σ
その他	最小改訂率 (前月比) はMaxlead=1の4.81

(注) 1～5. (1) に同じ。

(9) 代理店 (モデル推定期間: 昭和62年4月~平成27年12月)

データ加工 (注1)	対数変換
曜日調整 (注2)、異常値等 (注3)	2曜日型曜日調整、A02013. Mar
ARIMAモデル (注4)	(1 1 2) (1 1 1)
X-11パートの設定 (注5)	① モデルのタイプ: 乗法型 ② 移動平均項数: seasonalma=MSR (3×5) 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 1.5σ 上限 2.5σ
その他	最小改訂率 (前月比) はMaxlead=1の2.64

(注) 1~5. (1) に同じ。