

2024 年 4-6 月期以降に用いる X-12-ARIMA スペックについて

1. ARIMA 次数の検証（琉球大学 高岡先生）

法人企業統計四半期別調査 2024 年 1-3 月期までの現系列データを利用し、売上高（製造業）から設備投資・ソフト（非製造業）までの 10 系列の X-12-ARIMA スペックを検証した結果、以下 8 系列について現行モデルが最適モデルとなった。

- ・売上高（製造業）
- ・売上高（非製造業）
- ・経常利益（非製造業）
- ・営業利益（製造業）
- ・営業利益（非製造業）
- ・設備投資・ソフト除く（製造業）
- ・設備投資・ソフト除く（非製造業）
- ・設備投資・ソフト（製造業）

残りの 2 系列については最適モデルが現行モデルより変わったが、変更となったモデルと現行モデルの季節調整値や AIC 等の差異は軽微であり、各系列の時系列的性質に大きな変化が生じていないことが確認された。

2. 事務局からの提案

高岡先生の ARIMA 次数の検証結果に基づき、「経常利益（製造業）」、「設備投資・ソフト（非製造業）」の 2 系列について、最適モデルとされた ARIMA モデルへ変更を行うこととしたい（別添改正案のとおり）。

以上