

参考文献

- [1] 有田帝馬(2012)『入門季節調整: 基礎知識の理解から「X-12-ARIMA」の活用法まで』, 東洋経済新報社
- [2] 奥本佳伸(2000)「季節調整法の比較研究 センサス局法 X-12-ARIMA の我が国経済統計への適用」, 経済分析 政策研究の視点シリーズ, 17
- [3] 尾崎統(1997)「動的 X11 モデルと非線形季節調整 I-モデルと計算法-」, 統計数理, 第 45 巻, 第 2 号, 265-285
- [4] 北川源四郎(1997)「季節調整プログラム DECOMP とその後の展開」, 統計数理, 第 45 巻, 第 2 号, 217-232
- [5] 北川源四郎(2005)『時系列解析入門』, 岩波書店
- [6] 姜興起(2010)『ベイズ統計データ解析 (R で学ぶデータサイエンス 3)』, 共立出版
- [7] 佐藤整尚(1997)「Web Decomp の紹介-WWW 上で行う季節調整システム-」, 統計数理, 第 45 巻, 第 2 号, 233-243
- [8] 総務庁(1997) 季節調整法検討小委員会報告書
- [9] 高岡慎(2015)『経済時系列と季節調整法 (統計解析スタンダード)』, 朝倉書店
- [10] 高部勲(2005a)「状態空間モデルを用いた季節調整法の労働力調査への適用」, 統計研究彙報, 第 62 号
- [11] 高部勲(2005b)「完全失業率への適用でみた季節調整法の比較」, 統計研究彙報, 第 63 号
- [12] 高部勲(2009)「季節調整 TRAMO-SEATS 法の分析」, 統計研究彙報, 第 66 号
- [13] 高部勲(2017)「状態空間モデルに基づく季節調整法における改良方法の提案: 一般化 neg-log 変換の活用に基づくゼロ・負の値を含む時系列データの安定化と季節調整値の推定精度向上」, 統計研究彙報, 第 74 号
- [14] 高部勲(2018)「消費動向指数(CTI) : マクロ消費動向の推定について」, 統計研究彙報, 第 75 号
- [15] 野木森稔(2013)「季節調整法に関する最近の動向: X-12-ARIMA から X-13ARIMA-SEATS へ」, 季刊国民経済計算, 150, 41-58
- [16] 野村俊一(2016)『カルマンフィルタ -R を使った時系列予測と状態空間モデル-(統計学 One Point 2)』, 共立出版
- [17] 樋口知之(2011)『データ同化入門 -次世代のシミュレーション技術- シリーズ〈予測と発見の科学〉6』, 朝倉書店
- [18] 松本正博・松本雅子・森本聡(2010)「家計調査季節調整法の変更について」, 統計研究彙報, 第 67 号
- [19] 労働政策研究・研究機構(2006)「職業安定業務統計季節調整値の改善について -稼働日調整を中心として-」, 労働政策研究報告書, No.47
- [20] Adriaan M. Bloem, Robert J. Dippelsman, and Nils Ø. Mæhle (2001) “Quarterly National Accounts Manual: Concepts, Data Sources, and Compilation”, 2001, International Monetary Fund.
- [21] Genshiro Kitagawa, Will Gersch (1984) “A Smoothness Priors-State Space Modeling of Time Series with Trend and Seasonality”, Journal of the American Statistical Association, 79, 378-389.
- [22] U.S. Census Bureau (2011) “X-12-ARIMA Reference Manual, Version 0.3”, U.S. Census Bureau, U.S. Department of Commerce.
- [23] 統計数理研究所(2018) “TIMSAC for R package”, <http://jasp.ism.ac.jp/ism/timsac/>