

資金循環統計の季節調整値改定について

資金循環統計では、主要4部門（民間非金融法人企業、一般政府、家計、海外）における資金過不足の四半期計数について、参考系列として季節調整値を公表しています。今般、資金循環統計の遡及改定に伴い、2005年第2四半期以降の季節調整替えを実施しましたので、お知らせします。季節調整方法の概要は以下の通りです。

- 1) 米国センサス局法 X-12-ARIMA（バージョン 0.3）を使用。
- 2) 各系列とも加法型の季節調整を実施。事前調整における異常値と一時変化の検出・判定基準は、バージョン 0.3 のデフォルト設定による。
- 3) 各部門の資金過不足について、2005年第2四半期から2021年第4四半期までの四半期データを使用。その後は季節要素の予測値を用いて季節調整値を作成。

| 部門名 | ARIMA モデル | レベルシフト、ランプ |
|-----------|------------|------------|
| 民間非金融法人企業 | (011)(011) | なし |
| 一般政府 | (011)(011) | なし |
| 家計 | (110)(111) | なし |
| 海外 | (010)(011) | なし |

照会先：調査統計局経済統計課金融統計グループ 03-3279-1111（内線 3951）