

国際収支統計の季節調整替えについて

2017年5月11日
日本銀行 国際局

日本銀行では、国際収支統計のうち經常収支の主要項目について、米国商務省センサス局法 X-12-ARIMA により季節調整を実施しています。今般、季節調整替えを実施しましたので、お知らせします。国際収支統計の季節調整に用いた詳細設定は以下の通りです。

1. X-12-ARIMA は、バージョン 0.3 を使用。事前調整における異常値、一時変化の判定基準は、バージョン 0.3 のデフォルト設定による。
2. 各系列の季節調整期間は、1996年1月から2016年12月までの計21年間。1996年1月から2013年12月までは6版組み替え計数¹を用いている。2017年1月以降の国際収支統計については、季節要素の予測値を用いて季節調整済計数を作成する。
3. 直接投資収益以外の項目には乗法モデルを用い対数変換を実施。ARIMA モデルの選択は、非季節 ARIMA パート、季節 ARIMA パートのそれぞれについて、階差の次数を1、AR 項と MA 項の次数をそれぞれ 0~2 としたうえで自動作成機能を利用（2を超える場合もある。採用されたモデル・オプションの一覧は下表を参照）。ARIMA モデルによる先行き予測期間は48期。なお、後戻り予測は行っていない。

季節調整済計数および季節要素は、本ホームページの時系列統計データ検索サイトをご覧ください。

モデル・オプション設定一覧

項目	モデル	レベルシフト、ランプ	曜日・閏年調整
輸 出 ²	(010)(011)	あり	あり
輸 入 ²	(110)(011)	あり	あり
輸 送 (受)	(010)(011)	あり	あり
輸 送 (払)	(011)(011)	あり	あり
旅 行 (受)	(112)(011)	あり	なし
旅 行 (払)	(011)(011)	あり	あり
その他サービス(受)	(011)(011)	あり	あり
その他サービス(払)	(011)(011)	あり	あり
雇 用 者 報 酬 (受)	(011)(011)	なし	あり
雇 用 者 報 酬 (払)	(011)(011)	なし	なし
直 接 投 資 収 益 (受)	(210)(111)	なし	あり
直 接 投 資 収 益 (払)	(011)(011)	なし	なし
証 券 投 資 収 益 (受)	(210)(111)	なし	あり
証 券 投 資 収 益 (払)	(011)(010)	なし	あり
その他投資収益(受)	(011)(011)	なし	あり
その他投資収益(払)	(311)(011)	なし	あり
その他第一次所得(受) ³	—	—	—
その他第一次所得(払) ³	—	—	—
第 二 次 所 得 (受)	(311)(011)	なし	あり
第 二 次 所 得 (払)	(011)(011)	なし	あり

照会先

国際局国際収支課国際収支統計グループ Tel:03-3277-1381

¹ 6版組み替え計数は、国際収支マニュアル第5版の枠組みの下で収集した1996年1月から2013年12月までのデータを、国際収支マニュアル第6版に準拠する計数に組み替えたもの。

² 輸出入の曜日・閏年調整は通関日数をベースとしたユーザー定義変数を使用。

³ 「その他第一次所得」は2014年1月から公表を開始しており、季節調整を実施するためのデータ数が不十分である。このため、「その他第一次所得」の季節調整済計数は原計数によって代替。