

通貨流通高関連計数の季節調整値改定について

通貨流通高関連計数のうち、銀行券発行高平均残高および銀行券発行高末残について、定例の季節調整替えを実施しましたので、お知らせします（定例の季節調整替えは、原則として、前年分の確報データが揃った時点で実施しています）。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) 1968 年以降の季節調整値について、各系列とも乗法モデルを用い、対数変換を実施して算出。事前調整における異常値と一時変化の検出・判定基準はプログラムのデフォルト設定による。季節調整に用いたデータは 1968 年 1 月から直近の 12 月までの 56 年間とし、その後は季節要素の予測値を用いて季節調整値を作成。
 - 1967 年以前の季節調整値については前年から不変。
- 3) 曜日調整はユーザー定義変数を使用。

<季節調整を適用する際に用いたモデル>

指標名	ARIMA モデル	レベルシフト、ランプ	曜日調整	データ期間
銀行券発行高 平均残高	(010) (011)	1989 年 2 月 2002 年 2~4 月 2005 年 2~4 月	なし	1968 年 1 月~ 2023 年 12 月
銀行券発行高 末残	(112) (010)	2002 年 3 月 2005 年 3 月	あり	1968 年 1 月~ 2023 年 12 月