

労働力調査の2015年における季節調整値の改定について

労働力調査では、毎年1月分結果公表時に季節調整値の改定を行っています。主要系列については、2013年1月からreg-ARIMAモデルを導入しており、毎年の改定時にreg-ARIMAモデルを検証しています。

2015年における季節調整値の改定（2015年2月27日公表予定）では、主要系列の季節調整法におけるreg-ARIMAモデルの一部変更を行います。

労働力調査では、毎月、季節変動を除いた季節調整値^{注1}を計算し、公表しています。この季節変動の除去は、原数値を季節指数（各月の季節変動のパターンを表す数値）で除すことにより行っています。そして、毎年1月分結果公表時には、直近の季節パターンを的確に反映させるため、過去の時系列データに前年12か月分のデータを追加し、最大で過去29年分のデータを用いた遡及計算を行い、当年に適用する推計季節指数を算出するとともに、直近の10年分の結果を改定しています。

注1 季節調整値の詳細については、統計局ホームページ掲載の下記資料を御参照ください。

・季節調整値の算出方法 URL <http://www.stat.go.jp/data/roudou/kisetsu/index.htm>

・労働力調査の結果を見る際のポイント

No.4 原数値と季節調整値 URL <http://www.stat.go.jp/data/roudou/pdf/point04.pdf>

No.7 季節調整値の改定 URL <http://www.stat.go.jp/data/roudou/pdf/point07.pdf>

2015年における季節調整値の改定（2015年2月27日公表予定）では、主要系列の季節調整法におけるreg-ARIMAモデルの一部変更を行います。

主要系列の季節調整法におけるreg-ARIMAモデルの一部変更

労働力調査では、季節調整値のうち主要系列について、2013年1月分結果公表時からX-12-ARIMAにおけるreg-ARIMAモデルを導入しています。毎年の改定時に、主要系列におけるreg-ARIMAモデルの見直しを行っています。

今回の見直しの結果、2015年1月分結果から採用するreg-ARIMAモデルは、別紙のとおりとします。18系列中1系列の回帰変数を変更し、5系列のARIMAモデルを変更します。

表 2015年1月分から適用する reg-ARIMA モデル

		回帰変数 (種類・期間)	ARIMAモデル	ARIMAモデルの 変更の有無 【旧】	差の最大値 (直近の年 月)	差の最小値 (直近の年 月)
労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)		12 (2014年4月)	6 (2013年12月)
	男	-	(112)(012)		5 (2014年1月)	4 (2014年8月)
	女	LS2011.3	(012)(012)		11 (2014年4月)	6 (2014年6月)
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012)(111)	【(012)(012)】	10 (2014年4月)	5 (2013年12月)
	男	LS2009.3	(012)(012)	【(210)(012)】	5 (2014年1月)	6 (2014年3月)
	女	LS2009.3()	(012)(012)		10 (2014年4月)	6 (2013年12月)
雇用者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012)(012)	【(211)(212)】	11 (2014年4月)	8 (2014年7月)
	男	LS2009.3	(112)(012)	【(210)(012)】	4 (2014年2月)	5 (2014年3月)
	女	LS2009.3 LS2011.3	(211)(111)	【(211)(212)】	7 (2014年4月)	6 (2014年7月)
完全 失業者	男女計	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		3 (2014年2月)	3 (2014年7月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		2 (2014年5月)	1 (2014年8月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)		2 (2013年8月)	3 (2014年7月)
非労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)		6 (2013年12月)	10 (2014年4月)
	男	-	(112)(212)		5 (2014年3月)	5 (2014年1月)
	女	LS2011.3	(012)(012)		7 (2014年6月)	10 (2014年4月)
完全 失業率	男女計	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		0.1 (2014年5月)	0.1 (2014年7月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		0.1 (2014年2月)	0.1 (2014年8月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)		0.1 (2014年2月)	0.1 (2014年7月)

- ()就業者(女)の回帰変数(水準変化を調整する種類と期間)について、2014年は「LS2009.3」及び「LS2011.3」を設定していたが、検討の結果、「LS2011.3」は有意でなくなったと判断したため、2015年より削除する。他の系列の回帰変数については、今回の改定においては変更しない。
- ・上表のモデルの選定には1985年9月から2014年8月までの原数値(時系列接続用数値。長期時系列データ 表1「原数値」シートに掲載)を用いた。
 - ・ARIMAモデルについては、階差次数・季節階差次数はそれぞれ1に固定し、他の次数は2以下の範囲内でAIC(赤池情報量基準)の最小となるモデルについて、各次数の統計的な有意性を確認した上で選定した。
 - ・季節変動を算出する際の外れ値の管理限界は、季節調整済系列の安定性を重視する観点から、9.8~9.9としている。
 - ・曜日・休日調整及び閏年調整は、行っていない。
 - ・上表の「差の最大値」及び「差の最小値」における「差」とは、「モデル選定のための試算値」から「2014年12月現在の季節調整値」を減じた値である。
 - ・差の最大値及び最小値は、2015年における改定時には2014年12月までのデータを追加して再計算するため、2015年における改定後の公表値とは必ずしも一致しない。