

## 労働力調査の2016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。

2016年における季節調整値の改定（2016年3月1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<sup>注1</sup>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> >

2016年における季節調整値の改定（2016年3月1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、2016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6系列のARIMAモデルを変更します。

表 2016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 【旧モデル】	公表値との差	
					最大値	最小値
労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)		15 (2015年4月)	9 (2015年9月)
	男	-	(112)(012)		7 (2015年4月)	6 (2015年2月)
	女	LS2011.3	(012)(012)		8 (2015年4月)	5 (2015年6月)
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012)(012)	【(012)(111)】	12 (2015年4月)	6 (2015年9月)
	男	LS2009.3	(012)(012)		4 (2015年4月)	4 (2015年2月)
	女	LS2009.3	(012)(012)		7 (2015年4月)	6 (2015年6月)
雇業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012)(012)		9 (2015年4月)	8 (2015年9月)
	男	LS2009.3	(210)(012)	【(112)(012)】	3 (2015年4月)	4 (2015年9月)
	女	LS2009.3 LS2011.3	(211)(012)	【(211)(111)】	6 (2015年4月)	5 (2015年9月)
完全 失業者	男女計	RP2008.10-2009.7	(012)(011)	【(210)(011)】	2 (2015年5月)	3 (2014年1月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		3 (2015年4月)	3 (2015年1月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)		1 (2015年5月)	2 (2015年7月)
非労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)		9 (2015年9月)	15 (2015年4月)
	男	-	(112)(212)		6 (2015年2月)	7 (2015年4月)
	女	LS2011.3	(012)(212)	【(012)(012)】	6 (2015年9月)	7 (2015年4月)
完全 失業率	男女計	RP2008.10-2009.7	(012)(011)	【(210)(011)】	0.1 (2015年4月)	0.1 (2015年1月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)		0.1 (2015年4月)	0.1 (2015年1月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)		0.1 (2014年3月)	0.1 (2015年7月)

- ・上表のモデルの選定には1986年10月から2015年9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、 $9.8\sigma \sim 9.9\sigma$ 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」は、直近5年間について「モデル選定のための試算値」から「2015年改定の季節調整値」を減じて算出した値である。
- ・差の最大値及び最小値は、2016年における改定時には2015年12月までのデータを追加して再計算するため、2016年における改定後の公表値とは必ずしも一致しない。