

労働力調査の2018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。

2018年における季節調整値の改定（2018年3月2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> >

2018年における季節調整値の改定（2018年3月2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、2018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4系列のARIMAモデルを変更します。

表 2018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)		12 (2017年2月)	▲10 (2017年8月)
	男	-	(012) (012)	○ 【(112) (212)】	6 (2017年3月)	▲4 (2017年8月)
	女	LS2011.3	(012) (012)		7 (2017年3月)	▲7 (2017年8月)
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012) (012)		9 (2017年2月)	▲10 (2017年8月)
	男	LS2009.3	(012) (211)		3 (2017年5月)	▲2 (2017年9月)
	女	LS2009.3	(012) (012)		7 (2017年2月)	▲8 (2017年8月)
雇用者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(210) (012)		9 (2017年5月)	▲7 (2017年8月)
	男	LS2009.3	(210) (012)		8 (2017年5月)	▲3 (2016年12月)
	女	LS2009.3 LS2011.3	(012) (012)	○ 【(211) (012)】	6 (2017年3月)	▲7 (2017年8月)
完全 失業者	男女計	RP2008.10-2009.7	(210) (011)	○ 【(112) (011)】	4 (2016年3月)	▲4 (2017年5月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		3 (2017年3月)	▲3 (2017年5月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012) (011)		1 (2017年8月)	▲2 (2017年5月)
非労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012) (212)		9 (2017年8月)	▲14 (2017年2月)
	男	-	(112) (212)		3 (2017年8月)	▲5 (2017年3月)
	女	LS2011.3	(012) (212)		6 (2017年8月)	▲7 (2017年3月)
完全 失業率	男女計	RP2008.10-2009.7	(210) (011)	○ 【(112) (011)】	0.1 (2017年2月)	▲0.1 (2017年5月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		0.1 (2017年3月)	▲0.1 (2016年12月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012) (011)		0.1 (2016年7月)	▲0.1 (2017年5月)

- ・上表のモデルの選定には1988年10月から2017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「2017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、2018年における改定時には2017年12月までのデータを追加して再計算するため、2018年における改定後の公表値とは必ずしも一致しない。