

労働力調査の季節調整法における reg-ARIMA モデルの一部変更について（2022年改定）

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。

2022年における季節調整値の改定（2022年3月4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 < <https://www.stat.go.jp/data/roudou/kisetsu/index.html> >
- ・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 < <https://www.stat.go.jp/data/roudou/pdf/point04.pdf> >
 - No.7 季節調整値の改定 URL < <https://www.stat.go.jp/data/roudou/pdf/point07.pdf> >

注2 2022年1月分結果から、結果算出の基礎となるベンチマーク人口が2020年国勢調査基準（新基準）に切替わることに伴い、今回の改定では、新基準のベンチマーク人口に基づき遡及又は補正した時系列接続用数値を用いて季節調整値を算出します。

なお、ベンチマーク人口の切替え及びそれに伴う過去数値の変更については、以下 URL を御参照ください。

- ・2022年1月分結果からのベンチマーク人口の切替え及びそれに伴う過去数値の変更について URL < https://www.stat.go.jp/data/roudou/220201/pdf/kirikae_ft.pdf >

2022年における季節調整値の改定（2022年3月4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、2022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。24系列中 6系列の ARIMA モデルを変更します。

表 2022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	旧モデル
労働力人口	男女計	LS2011.3 LS2020.4	<u>(211)</u> (012)	(012) (012)
	男	TL2020.4-2020.6	(012) (111)	
	女	LS2011.3 LS2020.4	(012) (012)	
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3 LS2020.4	(111) (012)	
	男	LS2009.3 LS2020.4	(111) (012)	
	女	LS2009.3 LS2020.4	<u>(211)</u> (012)	(012) (012)
雇用者	男女計	LS2009.3 LS2011.3 LS2020.4	(111) (012)	
	男	LS2009.3 LS2020.4	(012) (111)	
	女	LS2009.3 LS2011.3 LS2020.4	<u>(012)</u> (112)	(012) (012)
正規の職員・従業員	男女計	-	<u>(012)</u> (012)	(210) (012)
	男	-	(012) (012)	
	女	-	(211) (211)	
非正規の職員・従業員	男女計	LS2020.4	(211) (111)	
	男	LS2020.4	(012) (111)	
	女	LS2020.4	<u>(211)</u> (012)	(010) (012)
完全失業者	男女計	RP2008.10-2009.7 RP2020.3-2020.10	(210) (011)	
	男	RP2008.10-2009.7 RP2020.3-2020.10	(210) (011)	
	女	RP2008.10-2009.3 RP2020.4-2020.8	(012) (011)	
非労働力人口	男女計	LS2011.3 LS2020.4	(012) (212)	
	男	TL2020.4-2020.6	<u>(012)</u> (212)	(012) (111)
	女	LS2011.3 LS2020.4	(012) (012)	
完全失業率	男女計	RP2008.10-2009.7 RP2020.3-2020.10	(210) (011)	
	男	RP2008.10-2009.7 RP2020.3-2020.10	(210) (011)	
	女	RP2008.10-2009.3 RP2020.4-2020.8	(012) (011)	

注) 下線は前年からの追加・変更箇所

- ・上表のモデルの選定には1992年11月から2021年10月まで(正規の職員・従業員及び非正規の職員・従業員は、2013年1月から2021年10月まで)の原数値(2020年国勢調査基準のベンチマーク人口に基づき、遡及又は補正した時系列接続用数値)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、 $9.8\sigma \sim 9.9\sigma$ としている。
- ・曜日・休日調整及び閏年調整は、行っていない。