

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（2024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。

2024年における季節調整値の改定（2024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。

2024年における季節調整値の改定（2024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、2024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 8系列の ARIMA モデル を変更します。

表 2024年1月分から適用する reg-ARIMA モデル

		ARIMAモデル	旧モデル	回帰変数 (種類・期間)	設定理由
労働力人口	男女計	<u>(212)</u> (212)	(211) (212)	LS2011. 3 LS2020. 4	東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	男	<u>(012)</u> (012)	(012) (111)	TL2020. 4-2020. 6	新型コロナウイルス感染拡大後の一時的水準変化
	女	(012) (012)		LS2011. 3 LS2020. 4	東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
就業者	男女計	(111) (012)		LS2009. 3 LS2011. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	男	(111) (012)		LS2009. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	女	(012) (012)		LS2009. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
雇用者	男女計	<u>(111)</u> (012)	(211) (012)	LS2009. 3 LS2011. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	男	(012) (111)		LS2009. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	女	<u>(012)</u> (112)	(012) (012)	LS2009. 3 LS2011. 3 LS2020. 4	リーマン・ショック後の水準変化 東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
正規の職員・従業員	男女計	(012) (012)		-	-
	男	(012) (012)		-	-
	女	<u>(211)</u> (012)	(111) (012)	-	-
非正規の職員・従業員	男女計	(211) (111)		LS2020. 4	新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	男	(012) (012)		LS2020. 4	新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	女	<u>(211)</u> (111)	(211) (012)	LS2020. 4	新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
完全失業者	男女計	(210) (011)		RP2008. 10-2009. 7 RP2020. 3-2020. 10	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化
	男	<u>(210)</u> (011)	(012) (012)	RP2008. 10-2009. 7 RP2020. 3-2020. 10	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化
	女	(012) (011)		RP2008. 10-2009. 3 RP2020. 4-2020. 8	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化
非労働力人口	男女計	(012) (212)		LS2011. 3 LS2020. 4	東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
	男	(012) (212)		TL2020. 4-2020. 6	新型コロナウイルス感染拡大後の一時的水準変化
	女	(012) (012)		LS2011. 3 LS2020. 4	東日本大震災後の水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の水準変化
完全失業率	男女計	(210) (011)		RP2008. 10-2009. 7 RP2020. 3-2020. 10	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化
	男	<u>(210)</u> (011)	(012) (012)	RP2008. 10-2009. 7 RP2020. 3-2020. 10	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化
	女	(012) (011)		RP2008. 10-2009. 3 RP2020. 4-2020. 8	リーマン・ショック後の傾斜的水準変化 新型コロナウイルス感染拡大後の傾斜的水準変化

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1994年10月から2023年9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2023年9月まで)の原数値を用いた。
- ・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。