

労働力調査の2017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。

2017年における季節調整値の改定（2017年3月3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^{注2}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>>

注2 2017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2015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。

- ・平成29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 <http://www.stat.go.jp/data/roudou/170131/pdf/ki_rikae.pdf>

2017年における季節調整値の改定（2017年3月3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、2017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5系列のARIMAモデルを変更します。

表1 2017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】
労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)	
	男	-	(112)(212)	【(112)(012)】
	女	LS2011.3	(012)(012)	
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(012)(012)	
	男	LS2009.3	(012)(211)	【(012)(012)】
	女	LS2009.3	(012)(012)	
雇用者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(210)(012)	【(012)(012)】
	男	LS2009.3	(210)(012)	
	女	LS2009.3 LS2011.3	(211)(012)	
完全 失業者	男女計	RP2008.10-2009.7	(112)(011)	【(012)(011)】
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)	
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)	
非労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012)(212)	
	男	-	(112)(212)	
	女	LS2011.3	(012)(212)	
完全 失業率	男女計	RP2008.10-2009.7	(112)(011)	【(012)(011)】
	男	RP2008.10-2009.7	(210)(011)	
	女	RP2008.10-2009.3	(012)(011)	

表2 完全失業率の公表値と改定季節調整値との差

	男女計	男	女
最大値	0.1 (2015年7月)	0.1 (2015年10月)	0.1 (2016年9月)
最小値	0.1 (2016年2月)	0.1 (2016年2月)	0.1 (2016年6月)

- ・表1のモデルの選定には1987年12月から2016年11月までの原数値(2015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以下の範囲内で赤池情報量基準(AIC)が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。
- ・表2は、完全失業率について「モデル選定のための試算値」から「2016年改定の季節調整値」を減じた「差」の最大値及び最小値を示している。なお、差が最大又は最小となる月が複数ある場合は、直近の月を示している。