

## 労働力調査の2019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。

2019年における季節調整値の改定（2019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 < <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> >

2019年における季節調整値の改定（2019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、2019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 2019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)		14 (2017年12月)	▲26 (2018年3月)
	男	-	(012) (012)		6 (2017年12月)	▲7 (2018年3月)
	女	LS2011.3	(012) (012)		10 (2018年6月)	▲19 (2018年3月)
就業者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(111) (012)	○ 【(012) (012)】	18 (2017年12月)	▲26 (2018年3月)
	男	LS2009.3	(111) (211)	○ 【(012) (211)】	7 (2017年12月)	▲7 (2018年3月)
	女	LS2009.3	(012) (012)		10 (2017年12月)	▲18 (2018年4月)
雇用者	男女計	LS2009.3 LS2011.3	(111) (012)	○ 【(210) (012)】	15 (2017年12月)	▲18 (2018年4月)
	男	LS2009.3	(111) (012)	○ 【(210) (012)】	5 (2017年12月)	▲4 (2017年5月)
	女	LS2009.3 LS2011.3	(012) (012)		9 (2018年6月)	▲15 (2018年4月)
完全 失業者	男女計	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		5 (2018年1月)	▲3 (2018年7月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		3 (2018年1月)	▲2 (2018年7月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012) (011)		2 (2018年1月)	▲2 (2017年12月)
非労働力 人口	男女計	LS2011.3	(012) (212)		26 (2018年3月)	▲15 (2017年12月)
	男	-	(012) (212)	○ 【(112) (212)】	7 (2018年4月)	▲7 (2017年12月)
	女	LS2011.3	(211) (212)	○ 【(012) (212)】	18 (2018年3月)	▲11 (2018年6月)
完全 失業率	男女計	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		0.1 (2018年5月)	▲0.1 (2017年10月)
	男	RP2008.10-2009.7	(210) (011)		0.1 (2018年1月)	▲0.1 (2018年7月)
	女	RP2008.10-2009.3	(012) (011)		0.1 (2018年5月)	▲0.1 (2018年9月)

- ・上表のモデルの選定には1989年10月から2018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「2018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、2019年における改定時には2018年12月までのデータを追加して再計算するため、2019年における改定後の公表値とは必ずしも一致しない。