

労働経済動向調査の季節調整の改訂について

1 労働経済動向調査の季節調整

労働経済動向調査では、令和7年までは、季節調整法に米国のセンサス局法（X-12-ARIMA）の中の X-11 を用いていたが、令和8（2026）年2月調査公表以降における季節調整値のうち調査産業計の各系列については、米国センサス局が公開している X-13ARIMA-SEATS（Version1.1, Build59）の X-12ARIMA を用いて季節調整を行う。

DIの季節調整値については、各系列の「増加」、「減少」の季節調整値の差分により算出する。

なお、調査産業計以外の個別産業については従来どおり X-12-ARIMA の中の X-11 により季節調整を行う。

2 調査産業計における REGARIMA モデル等について

表1 X-11 パートの設定等について（各系列共通）

データ加工	対数変換なし
X-11 パートの設定	季節調整のタイプ：加法型 移動平均項数：デフォルト（seasonalma=MSR） ヘンダーソン移動平均項数：デフォルト（自動選択） 特異項の管理限界：デフォルト（下限1.5 σ 上限2.5 σ ）
予測期間	4期（1年）

表2 令和8（2026）年2月調査から適用する REGARIMA モデル等

			ARIMA モデル	外れ値	曜日・ うるう年	休日・祝日	移動平均項数	ヘンダーソン 移動平均項数	
所定外 労働時間	実績	増加	(100)(011)	TC2020.3			3×5	5	
		減少	(100)(011)	TC2008.4,AO2009.1,AO2020.2	tdnolpyear	あり	3×5	5	
	見込	増加	(100)(011)	TC2020.3		tdnolpyear		3×5	5
		減少	(011)(011)	TC2009.1,AO2020.2		tdnolpyear		3×5	7
	見込	増加	(100)(011)	RP2008.4-2009.2				3×5	5
		減少	(011)(011)	TC2009.2,TC2020.3				3×5	5
正社員等	実績	増加	(011)(011)				3×5	7	
		減少	(011)(011)		lpyear		3×3	5	
	見込	増加	(200)(010)	AO2008.2				3×5	5
		減少	(011)(011)	RP2008.2-2009.1				3×5	5
	見込	増加	(200)(010)	AO2010.2,AO2021.2				3×3	5
		減少	(011)(011)	TC2009.2				3×5	5

			ARIMA モデル	外れ値	曜日・ うるう年	休日・祝日	移動平均項数	ヘンダーソン 移動平均項数
臨 時	実 績	増加	(1 0 0)(0 1 1)				3 × 5	5
		減少	(1 0 0)(0 1 1)	LS2008.4,LS2009.3			3 × 5	5
	見 込	増加	(1 0 0)(0 1 1)		tdnolpyear		3 × 5	5
		減少	(1 0 0)(0 1 1)	TC2009.1			3 × 5	5
	見 込	増加	(0 1 1)(0 1 1)	RP2008.4-2009.2			3 × 5	7
		減少	(2 0 0)(0 1 1)	TC2009.2	lpyear		3 × 5	5
パ ー ト タ イ ム	実 績	増加	(2 0 0)(0 1 1)				3 × 5	5
		減少	(1 0 0)(0 1 1)	RP2008.3-2009.2,LS2009.3			3 × 5	5
	見 込	増加	(1 0 0)(0 1 1)				3 × 5	5
		減少	(2 0 0)(0 1 1)	TC2009.1,TC2009.2			3 × 5	5
	見 込	増加	(0 1 1)(0 1 1)				3 × 5	7
		減少	(0 1 1)(0 1 1)	LS2009.1,TC2009.2	tdnolpyear		3 × 5	5
派 遣 労 働 者	実 績	増加	(0 1 1)(0 1 1)				3 × 5	5
		減少	(0 1 1)(0 1 1)	LS2008.4,TC2009.1,LS2009.3,TC2020.2			3 × 5	5
	見 込	増加	(0 1 1)(0 1 1)		tdnolpyear		3 × 5	5
		減少	(1 0 0)(0 1 1)	LS2008.4,TC2009.1			3 × 5	5
	見 込	増加	(0 1 1)(0 1 1)				3 × 5	5
		減少	(0 1 1)(0 1 1)	RP2008.3-2009.1,AO2009.2	lpyear	あり	3 × 5	5

- ・ 季節調整値の作成には 1999 年 2 月調査から 2025 年 11 月調査までの原数値を用いている。
- ・ 外れ値については、ARIMA モデル(0 1 1)(0 1 1)を使用し、outlier コマンドにより自動検出された外れ値を基に、①リーマンショック (2008 年 12 月前後)、②東日本大震災 (2011 年 3 月前後)、③新型コロナウイルス感染症の影響 (2020 年 4 月前後)、の 3 つの時期に該当し、外れ値の t-値の絶対値がおおむね 4 以上であり、かつ設定する理由の説明ができるものを職員が判断し、外れ値として設定した。
- ・ 曜日とうるう年、休日と祝日については、上記で設定した外れ値を設定したうえで、ARIMA モデル(0 1 1)(0 1 1)により、有意とみられるものを設定した。なお、曜日とうるう年については、td、tdnolpyear、tdlcoef、tdl1nolpyear、lpyear の各変数を、休日と祝日については、「国民の祝日に関する法律」に基づく祝日の数による日本型の祝日変数を設定した。
- ・ ARIMA モデルは、上記に基づき、外れ値、曜日とうるう年、休日と祝日を設定した上で automdl により設定している。
- ・ 新旧季節調整値 (「所定外労働時間判断 D.I.」、「正社員等雇用判断 D.I.」及び「パートタイム雇用判断 D.I.」) の比較は、令和 8 (2026) 年 2 月調査の公表の際に、本資料の別紙として追加する。

季節調整法に使用したスペックファイル (サンプル)

```
series{ file="*****.dat"  
        start=1999.1  
        span=(1999.1, )  
        period=4 }  
x11{mode=add  
     seasonalma=msr  
     sigmalim=(1.5 2.5)  
     appendfcst=yes  
     save=(d11, d16)}  
automdl{}  
regression{ variables=(tdnolpyear,TC2009.1,AO2020.2)}
```