

消費者物価指数に適用するReg-ARIMAモデル一覧（2021年設定）

作成系列ごとに、下表のとおりARIMAモデル及び外れ値を設定する\*。

(1) 全国

作成系列	ARIMA モデル (p d q) (P D Q)	外れ値
総合	(0 1 1) (0 1 1)	LS2014. 4
生鮮食品を除く総合	(1 1 0) (0 1 2)	LS2014. 4 LS2020. 4
生鮮食品及びエネルギーを除く総合	(1 1 1) (0 1 1)	LS2010. 4 LS2014. 4 LS2020. 4 LS2020. 8
財	(2 1 1) (1 1 1)	LS2014. 4
サービス	(0 1 1) (2 1 0)	LS2010. 4 LS2014. 4 LS2020. 4 LS2020. 8

(2) 東京都区部

作成系列	ARIMA モデル (p d q) (P D Q)	外れ値
総合	(0 1 1) (0 1 1)	LS2014. 4
生鮮食品を除く総合	(2 1 2) (0 1 1)	LS2014. 4 LS2020. 8
生鮮食品及びエネルギーを除く総合	(2 1 1) (1 1 0)	LS2014. 4 LS2020. 8
財	(2 1 2) (1 1 1)	LS2014. 4
サービス	(2 1 2) (2 1 0)	LS2010. 4 LS2011. 11 LS2014. 4 LS2020. 4 LS2020. 8

(3) ラスパイレス連鎖基準方式による指数（参考指数）

作成系列	ARIMA モデル (p d q) (P D Q)	外れ値
総合	(0 1 1) (0 1 1)	LS2014. 4
生鮮食品を除く総合	(0 1 1) (0 1 2)	LS2010. 4 LS2014. 4 LS2020. 4
生鮮食品及びエネルギーを除く総合	(1 1 0) (0 1 1)	LS2010. 4 LS2010. 10 LS2014. 4 TC2020. 4 LS2020. 8

\* 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以下の範囲内で考えられる組み合わせのうち、各次数の統計的な有意性を確認した上で、AIC（赤池情報量基準）の最小となるモデルを選定した。外れ値については、消費税率改定による指数水準の変化の影響、ウエイト等が異なる新旧基準指数を基準年1月に接続したことによる指数水準の変化の影響等について統計的な有意性を検証した上で、系列ごとに最適と考えられるものを選定した。なお、適用するReg-ARIMAモデルについては、毎年の季節調整済指数の改定時に、直近のデータを追加して見直す。