時間序列差分階數之偵測研究

虞國興; 陳惠龍

傳統上,對於非定常性時間序列轉換成定 常性時間序列,其差分階數之判定,並無明確的 判斷準則,往往須藉由經驗加以判定。本研究 利用自相關函數之95%信賴區間判斷序列所需之 差分階數。根據合成資料及實測資料分析結果 顯示,本研究所提之方法能準確判定具有趨勢 或週期性之非定常性時間序列所需之差分階數 。