**3.6、table3.21.csv**

內容

[**一、平穩性檢驗：** 2](#_Toc85954260)

[**二、純隨機性檢驗（）：** 3](#_Toc85954261)

[**三、確定合適的ARMA模型：** 4](#_Toc85954262)

[**四、參數估計，擬合模型的口徑：** 4](#_Toc85954263)

[**五、模型顯著性檢驗：** 5](#_Toc85954264)

[**六、參數顯著性檢驗：** 6](#_Toc85954265)

**一、平穩性檢驗：**

從時序圖可見，均不截尾，具有拖尾性。

图形用户界面, 应用程序

描述已自动生成

**二、純隨機性檢驗（）：**

各階延遲下，P值都非常小（<0.1），因此很大把握（置信水平>99%）是非白噪聲序列。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 延遲階數 | LB統計量檢驗 | |
| LB檢驗統計量的值 | P值 |
| 6 | 31.64 | P<0.05 |
| 12 | 38.58 | P<0.05 |

文本, 日历

描述已自动生成

**三、確定合適的ARMA模型：**

自相關圖与偏自相关图均拖尾

ARMA(1,1)

,

**四、參數估計，擬合模型的口徑：**

文本

描述已自动生成

**五、模型顯著性檢驗：**

殘差序列各階數延遲下LB統計量P值均顯著大於0.05，可認為此模型擬合殘差序列屬於白噪聲序列，即擬合模型顯著有效。

|  |  |
| --- | --- |
| 延遲階數 | P值 |
| 6 | 0.99 |
| 12 | 0.98 |
| 18 | 0.98 |

文本

低可信度描述已自动生成

**六、參數顯著性檢驗：**

均值

|  |  |
| --- | --- |
| 估計方法 | P值 |
| 極大似然 | <0.001 |

|  |  |
| --- | --- |
| 估計方法 | P值 |
| 極大似然 | <0.001 |

|  |  |
| --- | --- |
| 估計方法 | P值 |
| 極大似然 | <0.001 |

P值均小於0.05，參數檢驗均顯著。

文本

描述已自动生成