

定常性の獲得

差分変換

1時点離れた値との差をとる変換
平均に対して非定常な系列を定常にできる
場合がある

$$\Delta y_t = y_t - y_{t-1}$$

複数回行う場合がある(二階差分の例)

$$\Delta^2 y_t = \Delta y_t - \Delta y_{t-1}$$

周期性がある場合は同期分離れたデータとの
差分をとる(季節差分)

対数差分変換 (対数収益率)

$$\log(\Delta y_t) = \log(y_t - y_{t-1})$$