

# 第八次作业

---

## 问题一

按照定阶、估计参数、模型残差检验、预测的顺序使用AR，MA模型对以下数据建模

- (1) 使用AR、MA模型手动生成数据1、3、5阶的数据，并做逆向分析
- (2) 附件中的数据为GDP和固定资产投资额的数据，分别为季度和月度频率。

## 问题二

简述（可使用Word、Latex、手写等形式）

- (1) 如何判断宽平稳
- (2) 如何利用延迟算子判断可逆（MA模型）和平稳性（AR模型），以及求逆算子的问题