小作业提交要求：

1、根据课堂PPT及进一步查阅资料，编号（见名单）为奇数的同学请完成第1、3题，编号为偶数的同学请完成第2、3题。

2、以下提交的文件均不要压缩打包，请一个个上传；

3、要求word文档和pdf文件各一份，都命名为 学号-姓名-作业号（用13或23表示），程序放在文件的附录中（要求有清晰的注释），word中的程序不能用截图，直接给代码，可编辑，文档模板明天上传；

4、生成的数据放在EXCEL中，文件命名规则：数据，里面放入工作表：数据-AR、数据-MA、数据-ARMA；

5、同时还要给出源程序文件（要有清晰的注释），命名规则：模型1、模型2。

小作业1、模拟产生AR（3）模型数据300个，记为。自己编程（不是调用软件中现有函数）完成下列任务：

（1）画出时间序列图；

（2）计算该时间序列的样本均值、样本自相关函数、样本相关函数，样本偏自相关函数，，并画出、、随变化的图像；

（3）确定模型的阶数；

（4）估计参数；

（5）对模型进行检验；

（6）预测。

小作业2、模拟产生MA（3）模型数据300个，记为。自己编程（不是调用软件中现有函数）完成下列任务：

（1）画出时间序列图；

（2）计算该时间序列的样本均值、样本自相关函数、样本相关函数，样本偏自相关函数，，并画出、、随变化的图像；

（3）确定模型的阶数；

（4）估计参数；

（5）对模型进行检验；

（6）预测。

小作业3、模拟产生ARMA（2,2）模型数据300个，记为。自己编程（不是调用软件中现有函数）完成下列任务：

（1）画出时间序列图；

（2）计算该时间序列的样本均值、样本自相关函数、样本相关函数，样本偏自相关函数，，并画出、、随变化的图像；

（3）确定模型的阶数；

（4）估计参数；

（5）对模型进行检验；

（6）预测。

  

   