ADF检验 — 拟合AR模型 — 计算残差估计与rho的标准差 — 计算t统计量 — 查询DF临界值表（或t分布表）

$$t = \frac{\hat{\rho} - 1}{\hat{\sigma}_{\hat{\rho}}}$$

$$\hat{\sigma}_{\hat{\rho}} = \sqrt{\frac{s^2}{\sum y_{t-1}^2}}$$

$$s^2 = \frac{1}{T-2} \sum \hat{u}_t^2$$