

# Notas sobre Vetores Auto-regressivos

Gustavo Vital

1 de julho de 2020

Uma série temporal multivariada  $x_t = (x_1, x_2, \dots, x_n)$  é dita um vetor auto-regressivo de ordem 1 se segue o seguinte modelo:

$$Ax_t = \Gamma_0 + \Gamma_1 x_{t-1} + \epsilon \tag{1}$$