AR模型参数估计与阶数选择学习报告

一个序列经过预处理被识别为平稳非白噪声序列，那就说明该序列是一个蕴含着相关信息的平稳序列。在统计上我们通常是建立一个线性的模型来拟合该序列的发展，借此提取该序列中的有用信息，AR模型是目前最常用的平稳序列拟合模型。（<https://blog.csdn.net/dingming001/article/details/73459494>）

1.AR模型定义

顾名思义，自回归模型（Autoregressive Model，简称 AR 模型book）就是使用自身做回归变量，满足如下结构的模型称为p阶自回归模型，记为AR（p）：



该式表示，序列当前输出是前p个输出和当前干扰项的线性组合，通常假设是白噪声，服从。

假设对于时间序列到，我们可以得到如下（）个等式：  
<https://blog.csdn.net/liusandian/article/details/53079612>

<https://blog.csdn.net/u010866505/article/details/78229437?locationNum=2&fps=1>