

短文

## 确定ARMA模型MA阶数的一种方法

张贤达

清华大学自动化系

收稿日期 1992-4-21 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

本文提出一种ARMA模型MA定阶的新方法. 其基本思想是, 将阶数确定转化为一上三角阵的秩的确定. 仿真例子表明, 该方法在数值上是鲁棒的.

关键词 [系统辨识](#) [ARMA模型](#) [阶数确定](#) [奇异值分解](#) [总体最小二乘法](#)

分类号

## An Approach to MA Order Determination of ARMA Processes

Zhang Xianda

Department of Automation, Tsinghua University, Beijing

Abstract

This paper proposes an approach to MA order identification of general ARMA models using sample autocorrelations and AR parameter estimates. In this approach, the order identification reduces to the rank determination of an upper triangular matrix, whereas it can be accomplished by using simpler computations. The simulation examples show that our approach has good statistical performances and is numerically robust.

Key words [system identification](#) [ARMA model](#) [order determination](#) [SVD](#) [total least squares](#)

DOI:

通讯作者

作者个人主页 [张贤达](#)

### 扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(343KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“系统辨识”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
- [张贤达](#)