

论文

平稳非最小相位 AR(p)模型参数估计中的非线性方程组

许文源 (1), 林元淡 (2), 贾沛璋 (3)

(1)中国科学院系统科学研究所,北京;(2)中国科学院系统科学研究所,北京;(3)中国科学院系统科学研究所,北京

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 近年来由于实际应用的需要,

对非最小相位系统的辨识以及非最小相位时间序列模型的参数估计问题引起了许多作者的兴趣。非最小相位时间序列的参数估计中总是引出非线性问题,它们的分析和实际计算比线性问题要复杂得多。1978年 Wiggins 提出了一种称为最小熵反褶积(MED)处理方法。他的方法实际上就是求目标函数...

关键词

分类号

NONLINEAR EQUATIONS IN THE PARAMETER ESTIMATION OF STATIONARY NON-MINIMUM PHASE AR(p) MODEL

XU WEN-YUAN(1), LIN YUAN-DAN(2),JIA PEI-ZHANG(3)

(1)Institute of Systems Science,Academia Sinica;(2)Institute of Systems Science,Academia Sinica;(3)Institute of Systems Science,Academia Sinica

Abstract In this paper the model presented in [11] by Donoho is expressed as a much clearer model—a stationary nonminimum phase AR(p)model,and the nonlinear equations satisfying the parameters of this model are presented.Some objective functions,including (1.3) and(1.4),are also deduced.Finally,the convergence of the Picard iteration is discussed in detail

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(523KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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 无 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [许文源](#)

· [林元淡](#)

· [贾沛璋](#)