

ค่าความแปรปรวนมีค่าเท่ากัน จึงทำการวิเคราะห์ความแปรปรวนแบบทางเดียวเพื่อตรวจสอบว่าค่าเฉลี่ยของค่าเศษส่วนเหลือมีค่าเท่ากันหรือไม่ได้ผลดังในตารางที่ 11 ซึ่งพบว่าค่าเฉลี่ยของค่า

ตารางที่ 12 ค่าเฉลี่ยของค่าเศษส่วนเหลือกำลังสองจากการพยากรณ์ข้อมูลราคาปิดของหุ้นบริษัทแห่งหนึ่งด้วยตัวแบบ AR(1) เมื่อใช้วิธีกำลังสองน้อยสุด และวิธีของ Yule-Walker เพื่อพยากรณ์ไปข้างหน้าทีละหนึ่งช่วงเวลา แต่พยากรณ์ติดต่อกันเป็นเวลานาน

		ค่าเฉลี่ยของค่าเศษส่วนเหลือกำลังสอง		
AR(1)	จำนวนครั้งที่พยากรณ์	วิธีกำลังสองน้อยสุดร่วมกับวิธีเมตริกซ์ผกผัน		
		$\mu = 0$	$\hat{\mu} = \bar{x}$	ϕ_0
	1,000	0.8298	0.8792	0.8335
	2,000	1.0459	1.0693	1.0485
AR(1)	จำนวนครั้งที่พยากรณ์	วิธีกำลังสองน้อยสุดร่วมกับวิธี คิว อาร์		
		$\mu = 0$	$\hat{\mu} = \bar{x}$	ϕ_0
	1,000	0.8298	0.8792	0.8335
	2,000	1.0459	1.0693	1.0485
AR(1)	จำนวนครั้งที่พยากรณ์	วิธี Yule-Walker ร่วมกับวิธี recursion ของ Durbin-Levinson		
		$\mu = 0$	$\hat{\mu} = \bar{x}$	
	1,000	0.8645	0.8653	
	2,000	1.0629	1.0635	
AR(1)	จำนวนครั้งที่พยากรณ์	วิธี Yule-Walker ร่วมกับวิธีเมตริกซ์ผกผัน		
		$\mu = 0$	$\hat{\mu} = \bar{x}$	
	1,000	1.5659	0.8647	
	2,000	1.4578	1.0631	
AR(1)	จำนวนครั้งที่พยากรณ์	วิธี Yule-Walker ร่วมกับวิธี คิว อาร์		
		$\mu = 0$	$\hat{\mu} = \bar{x}$	
	1,000	1.5659	0.8647	
	2,000	1.4578	1.0631	