

Časové rady: Podmienka stacionarity pre AR(2) proces

Termín odovzdania: 30. 11. 2023

Bonusová úloha: Vyjadrite podmienku stacionarity pre AR(2) proces v tvare nerovností pre parametre procesu a toto tvrdenie dokážte.

Na kontrolu sa dajú použiť numerické výsledky (cvičenie 8 v slajdoch s cvičeniami k autoregresným procesom).

Hodnotenie: max. 3 body

Odovzdávanie:

- Bonus sa rieši samostatne alebo v dvojici
- Odovzdáva sa na papieri.
- Ak sa vychádza z nejakého dôkazu z literatúry, treba tieto podklady priložiť k riešeniu alebo ich poslať mailom na adresu beata.ulohy@gmail.com, s predmetom CR 2023 PMS - bonus AR2 - meno/mená. Často sú tieto dôkazy napísané stručne, v odovzdanom riešení treba všetko odvodiť podrobne, nemôže sa teda v dôkaze vyskytnúť nevysvetlené tvrdenie. Posielajte iba relevantnú časť (teda nie napr. celú knihu) a uveďte citáciu zdroja.