**Econometría II – Curso 2019/2020 – Grupo 237 – Ejercicios #1**

1. Sea el proceso , donde es ruido blanco.
   1. ¿Es estacionario dicho proceso?
   2. Expresarlo en su forma habitual.
2. Sea el proceso AR(1): , donde es ruido blanco.
3. ¿Es estacionario dicho proceso?
4. Expresarlo en notación de operadores.
5. Calcular el coeficiente de retardo de la función de autocorrelación teórica.
6. Representar el proceso como suma de innovaciones, MA(∞).
7. Sea el proceso AR(2): , donde es ruido blanco.
   1. ¿Es estacionario dicho proceso?
   2. Expresarlo en notación de operadores como producto.
   3. Calcular el coeficiente de retardo de la función de autocorrelación teórica.
   4. Representar el proceso como suma de innovaciones, MA(∞).
8. Sea el proceso AR(2): , donde es ruido blanco.
   1. ¿Es estacionario dicho proceso?
   2. Calcular los coeficientes de autocorrelación parcial teóricos.
9. Sea la función de autocorrelación de un proceso AR(3).
   1. ¿Es estacionario dicho proceso?
   2. Calcular los coeficientes de autocorrelación parcial teóricos.