**Econometría II – Curso 2019/2020 – Grupo 237 – Ejercicios #2**

1. Sea el proceso , donde es ruido blanco. Calcular la función de autocorrelación.
2. Sean los dos procesos: y , donde es ruido blanco. Demostrar que tienen la misma función de autocorrelación.
3. Sea el proceso MA(2): , donde es ruido blanco.
   1. ¿Es invertible dicho proceso?
   2. Calcular la función de autocorrelación.
   3. Representarlo como un proceso AR(∞).
4. Sea el proceso ARMA(1,1): , donde es ruido blanco.
   1. Calcular la función de autocorrelación.
   2. Representarlo como un proceso AR(∞).
   3. Representarlo como un proceso MA(∞).
5. Sea el proceso ARMA(2,1): , donde es ruido blanco.
   1. ¿Es estacionario dicho proceso? ¿Es invertible?
   2. Calcular la función de autocorrelación.