

Procesos univariados. Test de Lectura

Test de Lectura

Como discutiesemos, estos *tests de lectura* son una serie de preguntas simples que permiten monitorear si estan siguiendo efectivamente las clases. No seran corregidos ni evaluados, los administraran directamente ustedes. Cualquier duda que tengan sera discutida en nuestras sesiones sincronicas, la semana siguiente a publicado el material, luego de que hayan hecho un esfuerzo en trabajarlo, no antes. Es muy importante que trabajen este material y lo discutan entre ustedes y traigan esas dudas a la reunion sincronica.

1. Verdadero o Falso (V o F): en un proceso estacionario la varianza es constante en el tiempo.
2. Puede un proceso ser no estacionario y tener esperanza constante?
3. Si el proceso ruido blanco tuviese esperanza distinta de cero, dejaria ser estacionario?
4. Como se 've' en el grafico de ruido blanco que la varianza es constante?
5. Y que todas las correlaciones son nulas?
6. En el slide 8, y como dijimos en el video, en que sentido RB es predecible y en cual no?
7. Por que el proceso $MA(\infty)$ cumple un rol crucial en la caracterizacion de procesos estacionarios?
8. V o F: un proceso $AR(1)$ es un caso particular de $MA(\infty)$.
9. En que sentido $AR(1)$ es una representacion 'parsimoniosa' de $MA(\infty)$?
10. V o F: un proceso no estacionario es aquel que tiene esperanza variable en el tiempo.
11. Cual es la principal diferencia entre una tendencia deterministica y un RWD?
12. Ademas del precio de una accion, cual es otro ejemplo paradigmatico de serie que es un RW?
13. Como se 've' en el grafico de RW que la varianza es creciente?