

Promedio móvil (Moving Average, MA)

Estacionariedad (Stationarity)

Ruido blanco

Onda Cosenoidal aleatoria

## Covarianza

Dada una serie  $y_1, \dots, y_N$  decimos que la **esperanza** de la serie  $y_n$  es:

$$\mu_n = \mathbb{E}[y_n]$$

y la llamamos **función valor medio**. La esperanza es respecto de la distribución de  $y$ . La **covarianza** de una serie de tiempo entre dos instantes  $y_N$  e  $y_{N-k}$  está dada por:

$$\text{Cov}[y_N, y_{N-k}] = \mathbb{E}[(y_N - \mu_N)(y_{N-k} - \mu_{N-k})]$$

y se denomina **autocovarianza** de la serie de tiempo  $y_n$ .