

**Q1.**

시계열  $x_t$  가  $x_t = B_1 + B_2 t + w_t$  와 같이 정의될 때,  $y_t = x_t - x_{t-1}$  가 강 정상성 (strong stationarity)을 갖는 시계열임을 보이시오.

(단,  $B_1, B_2$  는 상수,  $w_t$  는 평균이 0, 분산이  $\sigma^2$ 인 백색잡음)

---

**Q2.**

다음과 같이 주어진 AR(2) 모형의 ACF와 PACF를 구하시오.

$$X_t = 0.8X_{t-2} + Z_t, \quad \{Z_t\} \sim WN(0, \sigma^2)$$