

<Assignment 2>

$\{\epsilon_t\}$ 가 백색잡음과정 $WN(0, \sigma_\epsilon^2)$ 을 따를 때, 다음과 같은 확률과정 $\{Z_t\}$ 를 생각해 보자.

$$Z_t = \mu + \epsilon_t + \theta_1 \epsilon_{t-1} + \theta_2 \epsilon_{t-2}, \quad t = 1, 2, \dots$$

확률과정 $\{Z_t\}$ 에 대하여 $k = 0, 1, 2, 3$ 일 때 γ_k 를 구하시오.