

Sea X_t un proceso intrínsecamente estacionario. El semivariograma de X_t se define como

$$\gamma_X(h) = \frac{1}{2} \mathbb{E} [(X_{t+h} - X_t)^2].$$

1. Si X_t es un ruido blanco con varianza σ^2 , calcule $\gamma_X(h)$.

SOLUCIÓN. test

2. Si $X_t = \beta_0 + \beta_1 t + \epsilon_t$, donde ϵ_t es un ruido blanco con varianza σ^2 , calcule $\gamma_X(h)$.

SOLUCIÓN. test