

Sea  $\{X_t : t \in T\}$  un proceso estacional normal con función con media  $\mu_X$  y función de autocovarianzas  $C_X(\cdot)$ . Definamos la serie no lineal

$$Y_t = \exp(X_t), \quad t \in T. \quad (0.1)$$

1. Exprese la media del proceso  $Y_t$  en términos de  $\mu_X$  y  $C(0)$ .

SOLUCIÓN. test

2. Determine la función de autocovarianza de  $Y_t$ .

SOLUCIÓN. test