

Considere el proceso $X_t = \delta + X_{t-1} + \epsilon_t$, donde $t = 1, 2, \dots$, ϵ_t es una secuencia de variables aleatorias iid con media cero y varianza σ^2 .

1. Escriba la ecuación del proceso X_t como sigue

$$X_t = \delta t + \sum_{j=1}^t \epsilon_j. \quad (0.1)$$

SOLUCIÓN. test

2. Calcule $\mu(t) = \mathbb{E}[X_t]$ y $V(t) = \mathbb{V}[X_t]$.

SOLUCIÓN. test

3. ¿Es el proceso X_t débilmente estacionario?

SOLUCIÓN. test