

Emne:
Tidsrækkeanalyse

Kasper Rosenkrands

ARMA processer, herunder stationaritet, invertibilitet, kausalitet

- ▶ Definitioner, antagelser og vigtige egenskaber
- ▶ ACF og PACF.
- ▶ Hvad er specielt interessant eller vigtigt ifm. AR
- ▶ processer, MA pro-cesser og ARMA processer?
- ▶ Hvorved adskiller ARMA sig fra AR og MA i anvendelser?
- ▶ Forecastegenskaber?
- ▶ $AR(\infty)$ og $MA(\infty)$?
- ▶ Hvordan kan man opskrive vha. lag-polynomier og hvordan er
- ▶ disse nyttige?