

8.2.1

- AR(1), $y_t = 0.7y_{t-1} + e_t$, $n = 100$, примерно 2:12-5:20
- MA(1), $y_t = \varepsilon_t - 0.8e_{t-1}$, $n = 100$, примерно 5:50-6:23
- ARMA(1,1), $y_t = 0.5y_{t-1} + \varepsilon_t - 0.8e_{t-1}$, $n = 100$, примерно 6:50-7:30
- ARMA(1,1), $y_t = -0.5y_{t-1} + \varepsilon_t - 0.8e_{t-1}$, $n = 100$, примерно 7:37-8:20

8.2.2

- $y_t = y_{t-1} + e_t$, $n = 100$, примерно 0:51-1:48
- $y_t = y_{t-1} + e_t$, $n = 500$, примерно 2:17-2:40
- $\begin{cases} x_t = 0.7x_{t-1} + \varepsilon_t, n = 100 \\ y_t = \frac{10}{99}(t-1) + x_t \end{cases}$, примерно 3:28-4:05
- $\begin{cases} x_t = 0.7x_{t-1} + \varepsilon_t, n = 100 \\ y_t = \frac{2}{99}(t-1) + x_t \end{cases}$, примерно 4:25-5:33

8.2.3

- Модель 1: $(\hat{y}_t - 579) = 1.04(y_{t-1} - 579) - 0.25(y_{t-2} - 579) + \varepsilon_t$, 2:09
- Модель 2: $(\hat{y}_t - 579) = 0.74(y_{t-1} - 579) + \varepsilon_t + 0.32\varepsilon_{t-1}$, 2:53
- Модель 3: $(\hat{y}_t - 579) = 0.78(y_{t-1} - 579) - 0.03(y_{t-2} - 579) + \varepsilon_t + 0.28\varepsilon_{t-1}$, 4:08
- Модель 4: $\Delta\hat{y}_t = 0.13\Delta y_{t-1} + \varepsilon_t$, 6:00
- Модель A: $\Delta\hat{y}_t = -0.02 + \varepsilon_t + 0.05\varepsilon_{t-1} - 0.31\varepsilon_{t-2} - 0.30\varepsilon_{t-3} - 0.23\varepsilon_{t-4}$, 7:28

8.2.4

- Модель 1: $\hat{y}_t = y_{t-1} + e_t$, примерно 4:33
- Модель A: $\hat{y}_t = y_{t-1} + e_t$, примерно 5:58
- Модель 1: $\Delta\hat{y}_t = -187 + 0.39\Delta y_{t-1} + e_t$, примерно 8:52

8.2.5

- Модель 1: $\hat{y}_t = 101 + 0.58y_{t-1} + 0.63y_{t-12} + e_t$, примерно 6:18