

Skilið í fyrirlestri 18. febrúar.

1. Reiknið dæmi 1. í kafla 11 (5. útgáfa), eða dæmi 9 í kafla 8 (6. útgáfa), eða dæmi 9 í kafla 9 (7. útgáfa).
2. Búið til tvær tímaraðir x_t og y_t af lengd 200 skv. eftirfarandi formúlum:

$$x_t = x_{t-1} + \varepsilon_t$$

$$y_t = y_{t-1} + e_t$$

þar sem ε_t og e_t eru normal white-noise. Reiknið fylgni og prófið með venjulegu (kennslubókar) prófi hvort fylgnin sé 0. Endurtakið nokkrum sinnum og haldið bókhald yfir hve oft $H_0 : \rho_{xy} = 0$ er hafnað.

3. Lesið inn gögnin í töflu F5.1 og metið jöfnuna í example 12.1, bls. 250 (útgáfa 5), example 19.1 bls. 626 (útgáfa 6), F5.2 í example 20.1 bls. 944 (útgáfa 7). Framkvæmið Box-Pierce próf fyrir sjálffylgni.