

Yule-Walker egyenletek levezetése

$PACF(k)=0$, ha $k > p$ (AR(p)-re)

A stacionaritás kapcsolata a karakterisztikus polinom gyökeivel (levezetés gondolatmenet)

Irodalom:

- <http://matthieustigler.github.io/Lectures/Lect2ARMA.pdf>
- Márkus László jegyzete (megtalálható a honlapján, jóval több van benne, mint amennyi most szerepelt)