

## APÉNDICE D

Funciones de Autocorrelación y Autocorrelación Parcial Teóricas para modelos AR(1) y MA(1). Para todos los modelos se cumple que  $A_t \sim N(0, \sigma_A^2)$ .

Modelos Teóricos	Función de Autocorrelación Teórica	Función de Autocorrelación Parcial Teórica
<p>Autorregresivo de primer orden</p> <p>AR(1), ARMA(1,0) ó ARIMA(1,0,0)</p> <p><math>\phi_1 &gt; 0</math></p> <p><math>Z_t = \theta_0 + \phi_1 Z_{t-1} + A_t</math></p> <p><math>-1 &lt; \phi_1 &lt; 1</math></p>		
<p>Autorregresivo de primer orden</p> <p>AR(1), ARMA(1,0) ó ARIMA(1,0,0)</p> <p><math>\phi_1 &lt; 0</math></p> <p><math>Z_t = \theta_0 + \phi_1 Z_{t-1} + A_t</math></p> <p><math>-1 &lt; \phi_1 &lt; 1</math></p>		
<p>Promedio móvil de primer orden</p> <p>MA(1), ARMA(0,1) ó ARIMA(0,0,1)</p> <p><math>\theta_1 &gt; 0</math></p> <p><math>Z_t = \theta_0 + A_t - \theta_1 A_{t-1}</math></p> <p><math>-1 &lt; \theta_1 &lt; 1</math></p>		
<p>Promedio móvil de primer orden</p> <p>MA(1), ARMA(0,1) ó ARIMA(0,0,1)</p> <p><math>\theta_1 &lt; 0</math></p> <p><math>Z_t = \theta_0 + A_t - \theta_1 A_{t-1}</math></p> <p><math>-1 &lt; \theta_1 &lt; 1</math></p>		

Fuente: O'Donovan, 1983