

STATIONAARISET AIKASARJAT
vaatimukset 2. välikokeeseen 14.12.2012

Luvut 4–5 pois lukien seuraavat kohdat:

- Jakso "Application: Exact Finite-Sample Forecasts for an MA(1) Process" sivuilla 95–98.
- Jakso "An alternative Expression for the Likelihood Function" sivuilla 119–122.
- Jakso "Evaluating the Likelihood Function" sivuilla 123–125.
- Jakso "Maximum Likelihood Estimates for Non-Gaussian Time series" sivuilla 126–127.
- Jakso "Exact Likelihood Function" (MA(1):stä koskien) sivuilla 128–129.
- Jakso "Exact Likelihood Function" (MA(q):ta koskien) sivuilla 130–131.
- Jaksot "Grid Search", "Steepest Ascent" ja "Davidon-Fletcher-Powell" sivuilla 133–137 ja 139–142.
- Luvun 5 loppu alkaen jaksosta "Lagrange Multiplier Test" sivulla 145.

Vaatimuksiin kuuluvat luennoilla tehdyt täydennykset kirjaan ja kurssin kotisivulla oleva materiaali (mm. Millsin kirjasta).