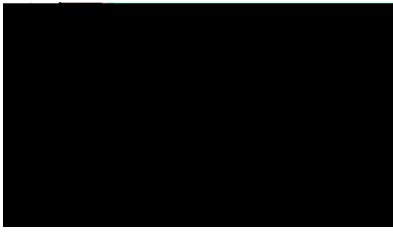


y y n y n y P
y n y n y n



L A

L A M

y_1, \dots, y_n "n" y_1, \dots, y_n \mathbf{P}

•

y₁ y₂ ... y_n y₁ y₂ ... y_n P

A BA L

y₁ y₂ ... y_n y₁ y₂ ... y_n ^P t

L

L AL

⌈

M

⌈

y₁ y₂ ... y_n " n t₁ t₂ ... t_n P

y₁ y₂ ... y_n " n y₁ y₂ ... y_n P

A A A A LABEL MAL

A L

A L A A

- a
- a
- a
-

a a ann

g

a 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0

y y n y n y P t

a na n a n n

a y a an a y a

a

a y a

y_1, \dots, y_n "n" y_1, \dots, y_n \mathbf{P}

y_1, \dots, y_n "n" y_1, \dots, y_n \mathbf{P}

y l y n y n t l n y P t

L A B L A A
A an

on n Mana

A v

A AL A

у і у ін-у "н " ь і ін-у^Р ь

а на і н. а нн	а а о а у і а
-------------------	------------------

$$y_{t+1} - y_t = \alpha (y_t - y_{t-1}) + \epsilon_t$$