

Это PT Sans с математикой mathastext

Предполагается, что циклическая компонента является стохастической и управляется следующим процессом:

$$\psi_t = \rho \cos(\lambda_c) \psi_{t-1} + \rho \sin(\lambda_c) \psi_{t-1}^* + \kappa_t,$$

$$\psi_t^* = -\rho \sin(\lambda_c) \psi_{t-1} + \rho \cos(\lambda_c) \psi_{t-1}^* + \kappa_t^*,$$

где $\text{Var}(\kappa_t) = \text{Var}(\kappa_t^*) = \sigma_\kappa^2$. Далее, γ_t – это сезонная компонента на основе фиктивных переменных:

$$\gamma_t = \sum_{j=1}^{s-1} \gamma_{t-j} + \omega_t$$

Преобразование Лапласа:

$$f(\mathbf{Y}) \approx \int f_d(\mathbf{Y}, \Lambda) d\Lambda = e^l \int g(\Lambda) d\Lambda = e^l.$$