

Fuente: Ayudantía N°1 de Econometría II (2021)

Ejercicio 3 Considere la siguiente serie

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 y_{t-1} + e_t + \alpha_1 e_{t-1}, \quad (1)$$

$$e_t \sim i.i.d.(0, \sigma^2) \quad (2)$$

Asumiendo estacionariedad débil calcule

- Esperanza incondicional.
- Varianza incondicional.
- Autocovarianza incondicional de primer orden.