## Fuente: Examen de Econometría II 2021

 ${\bf 2.}~({\bf 30~puntos})$  Considere el siguiente proceso:

$$y_t = \alpha_1 y_{t-1} + \alpha_2 y_{t-2} + u_t \tag{1}$$

donde  $u_t \sim (0, \sigma^2)$ .