

**Fuente: Examen Final de Econometría II 2021**

**2. (35 puntos)** Considere el modelo:

$$y_t = \phi y_{t-1} + u_t \quad (1)$$

- **(a) (10 puntos)** Usted está interesado en testear la hipótesis nula de estabilidad del proceso, contra la alternativa de un quiebre estructural en  $t = T_0$ , donde  $T_0$  es conocido. Describa, en detalle, el test que utilizaría.
- **(b) (10 puntos)** Suponga ahora que desea testear la nula de estabilidad, contra la alternativa de un quiebre en  $t = T_0$ , donde  $T_0$  es desconocido. Describa, en detalle, el test que utilizaría.
- **(c) (15 puntos)** Describa, en detalle, los tests que utilizaría para testear por más de un quiebre estructural en fechas desconocidas.