

Fuente: Examen de Econometría II 2021

2) (15 puntos) Considere el modelo

$$y_t = \beta_1 y_{t-1} + \beta_2 y_{t-2} + u_t \quad (1)$$

$$u_t \sim N(0, \sigma^2) \quad (2)$$

Demuestre que para que y sea débilmente estacionario se requiere que $|\beta_1| < 1$.