

Fuente: Control 5 de Econometría II 2021 (Soluciones propuestas)

1. (20 puntos) Dado que $\alpha, \beta > 0$, para que el proceso de η sea débilmente estacionario se requiere que $\alpha + \beta < 1$. La varianza incondicional de este proceso es:

$$\eta = \frac{\sigma^2}{1 - \alpha - \beta} \quad (1)$$