

CONSIDERE EL SIGUIENTE PROCESO

$$Y_t = \rho Y_{t-1} + \mu_t ; \quad \mu_t \sim WN(0, \sigma_\mu^2)$$

Si $\rho = 1$, ENTONCES

$$Y_t - Y_{t-1} = \mu_t$$

$$(1-B)Y_t = \mu_t$$

EL POLINOMIO CARACTERISTICO DE $(1-B)$ SERIA

$$1-x=0 \quad \text{CUYA RAIZ SERIA } x=1$$

Si $|\rho| < 1$, ENTONCES EL PROCESO ES ESTACIONARIO, EN ESTE CASO DECIMOS QUE EL PROCESO ES DE RAIZ UNITARIA Y NO CUMPLE CON LA CONDICION DE ESTACIONARIEDAD