

MAESTRÍA EN ECONOMÍA INTERNACIONAL – dECON - FACULTAD DE CIENCIAS SOCIALES

MODELOS ECONOMETRICOS DINÁMICOS

Profesor: Elizabeth Bucacos

ENTREGABLE Nº2 - 2019

Fecha entrega del enunciado: 12/07/2019

Fecha entrega de la práctica: 23/07/2019

Su base de datos serán los índices de precios de productos que integran el IPC del Uruguay, diciembre de 2010=100, que elabora el Instituto Nacional de Estadística (INE) para el período 2011M02 – 2019M06. Puede acceder a ellos a través de la página web del INE. Además, Ud. debe incorporar a la muestra precios de productos básicos (carne, soja, petróleo y alimentos) expresados en pesos uruguayos.

Se pide:

1. Analice la posibilidad de encontrar factores comunes entre los componentes del IPC, que resuman características específicas en los datos. Estímelos. ¿Hay una única forma de hacerlo? ¿El resultado es el mismo? (10 puntos) *Sugerencia:* trabaje con las series (en logaritmos) estacionarias.
2. Estudie el grado de vulnerabilidad de la inflación doméstica a cambios en el entorno externo. (*Ayuda:* estime un FAVAR y realice análisis de impulso-respuesta) (5 puntos)
3. Presente un breve informe explicando los hallazgos de su investigación, donde aparezcan cuadros resúmenes, gráficas, etc. que sustenten el mismo. Además, esgrima alguna recomendación de política económica. (10 puntos)