

Econometría II - Trabajo 1

1. Seleccione una serie de tiempo económica (nacional o internacional) que contenga al menos 70 observaciones, haga e interprete la prueba de raíz unitaria. Aplique a la serie la Metodología Box-Jenkins **completa** (identificación, estimación, validación y pronóstico). Realice el pronóstico 7 pasos adelante.
2. Tome la serie de tiempo que seleccionó para el punto anterior, elija mínimo una serie de tiempo adicional y estime el modelo VAR adecuado. Identifique, estime, valide y haga pronóstico (5 pasos adelante). Seleccione una variable de su modelo y haga el respectivo análisis impulso respuesta sobre las demás variables, interprete. En no más de dos párrafos, realice una interpretación económica del modelo.
3. Encuentre mínimo dos series de tiempo económicas con al menos 70 observaciones cada una y que estén cointegradas según la prueba de Engle-Granger, haga el test de Johansen, compare e interprete. Identifique, estime y valide el modelo VECM adecuado. Estime el Modelo de Mínimos Cuadrados Ordinarios Dinámicos y el Modelo de Corrección de Error, interprete y compare con los resultados anteriores. En no más de dos párrafos, realice una interpretación económica del modelo.

Reglas de formato y presentación:

- Debe ser realizado en grupos de máximo 3 personas, para ser entregado en formato **PDF** el 16 de mayo de 2021 por medio de la plataforma Moodle.
- La extensión máxima del trabajo es de 12 páginas sin incluir los anexos.
- No puede usarse series de tiempo que hagan parte de los dataset de alguna librería de R.
- Incluya en un anexo el código usado. El anexo incluirlo dentro del trabajo, no como archivo adicional.
- Interprete cada gráfica, tabla y test que incluya. No agregue nada que no pueda explicar.
- Las personas que estén repitiendo la materia no pueden usar series de tiempo que hayan utilizado en semestres anteriores.