

Macroeconometría - Ejercicio Empírico 4

Mauricio Tejada

Universidad Alberto Hurtado

Preguntas

El archivo `datos_ejercicio_empirico_4.xlsx` contiene información trimestral de las cuentas nacionales de Chile para el periodo 1986 y 2019 (para evitar efecto pandemia en los datos). Los datos están expresados en términos reales y han sido ajustados por estacionalidad. En particular tenemos:

- Consumo (consumo privado + consumo público)
- Inversión
- Exportaciones
- Importaciones
- PIB

Determine el orden de integración $I(d)$ de cada una de estas series de tiempo. trabaje en logaritmos. Explique en cada caso el procedimiento usado para definir el modelo de la prueba Dickey y Fuller y el valor crítico usado para tomar una decisión.