

1. Dado el siguiente modelo:

$$IP_t = \alpha + \beta_0 PBIR_t + \beta_1 PBIR_{t-1} + \cdots + \alpha_0 M_t + \alpha_1 M_{t-1} + \cdots + \mu_t$$

De acuerdo a la propuesta de Koyck y con base a la data **Data_Examen Parcial**

- a) Deducir el modelo a estimar
- b) Escribir la regresión del modelo propuesto
- c) ¿Cuáles son los efectos de corto plazo y de largo plazo? ¿el efecto de corto plazo es estadísticamente significativo? ¿Por qué?

6:00 pm a 6:40 pm

40 Minutos

2. Dado el siguiente modelo:

$$IP_t = \alpha + \beta_0 PBIR_t + \beta_1 PBIR_{t-1} + \cdots + \alpha_0 M_t + \alpha_1 M_{t-1} + \alpha_2 M_{t-2} + \mu_t$$

Suponiendo polinomio de grado 1, de acuerdo a la propuesta de Almon y con base a la data **Data_Examen Parcial**

- a) Deducir el modelo auxiliar a estimar
- b) Escribir la regresión del modelo propuesto
- c) ¿Cuáles son los efectos de corto plazo y de largo plazo? ¿Son estadísticamente significativos? ¿Por qué?

6:45 pm a 7:25 pm

40 Minutos

3. Dado el siguiente modelo:

$$IP_t = \sum_{i=1}^3 \alpha_i PBI_{t-i} + \sum_{j=1}^3 \beta_j CP_{t-j} + \mu_{1t}$$

$$PBI_t = \sum_{i=1}^3 \lambda_i PBI_{t-i} + \sum_{j=1}^3 \delta_j IP_{t-j} + \mu_{2t}$$

Resumen								
<i>Estadísticas de la regresión</i>								
Coeficiente de correlación múltiple	0.887446							
Coeficiente de determinación R^2	0.787561							
R^2 ajustado	0.774814							
Error típico	8314.173							
Observaciones	54							
ANÁLISIS DE VARIANZA								
		<i>Grados de libertad</i>	<i>de cuadro de los cu</i>	<i>F</i>	<i>lor crítico de F</i>			
Regresión	3	1.28E+10	4.27E+09	61.78713	7.75E-17			
Residuos	50	3.46E+09	69125481					
Total	53	1.63E+10						
		Coeficiente	Error típico	Estadístico	Probabilidad	Inferior 95%	Superior 95%	Inferior 95%
Intercepción		13549.63	7456.799	1.817084	0.0752	-1427.79	28527.05	-1427.79
Variable X 1		0.531944	0.136391	3.90015	0.000287	0.257995	0.805893	0.257995
Variable X 2		0.075061	0.161882	0.463676	0.644892	-0.25009	0.40021	-0.25009
Variable X 3		0.286464	0.136801	2.094019	0.041349	0.011691	0.561236	0.011691

Resumen								
<i>Estadísticas de la regresión</i>								
Coeficiente de correlación múltiple	0.887508							
Coeficiente de determinación R^2	0.78767							
R^2 ajustado	0.77493							
Error típico	8312.031							
Observaciones	54							
ANÁLISIS DE VARIANZA								
		<i>Grados de libertad</i>	<i>de cuadro de los cu</i>	<i>F</i>	<i>lor crítico de F</i>			
Regresión	3	1.28E+10	4.27E+09	61.82757	7.65E-17			
Residuos	50	3.45E+09	69089866					
Total	53	1.63E+10						
		Coeficiente	Error típico	Estadístico	Probabilidad	Inferior 95%	Superior 95%	Inferior 95%
Intercepción		22258.43	7080.432	3.143654	0.002806	8036.962	36479.9	8036.962
Variable X 1		3.137128	0.57718	5.435269	1.63E-06	1.977828	4.296427	1.977828
Variable X 2		-3.15284	0.849506	-3.71138	0.000519	-4.85912	-1.44655	-4.85912
Variable X 3		3.220589	0.583704	5.517506	1.22E-06	2.048185	4.392992	2.048185

Con base a la data **Data_Examen Parcial**, ¿Cuál es la dirección de la causalidad según la Prueba de Granger?

7:30 pm a 8:00 pm

30 Minutos