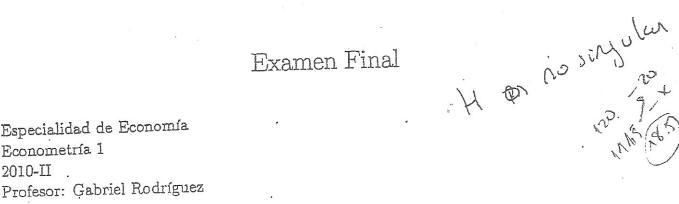


FACULTAD DE CIENCIAS SOCIALES

Examen Final

Especialidad de Economía Econometría 1



Indicaciones: Todas las secciones son obligatorias. El número de puntos que aparece entre paréntesis corresponde al número de minutos que Ud. debería asignar a la sección respectiva. En consecuencia, la duración del examen es de 2 horas (120 puntos). Ningún material de consulta del curso es permitido. (1-82742-60

Sección 1 (40 puntos)

Defina (brevemente) los siguientes conceptos:

Im Pr (6-0) (6) 3 1. Estimador consistente

2. Convergencia en media cuadrática

3. El método Newton-Raphson

4. La trilogía de estadísticos: Wald, LM y LR

5. Causalidad de Granger

6. Condición de orden y de rango (ecuaciones simultáneas)

Método de variables instrumentales

8. Modelo censorado y modelo truncado

2 Sección 2 (80 puntos)

1. (20 puntos) Escriba un pequeño reporte (1 a 2 páginas) sobre el tema de heterocedasticidad (consecuencias sobre $\widehat{\beta}^{MCO}$, tests y soluciones)

2. (20 puntos) Escriba un pequeño reporte (1 a 2 páginas) sobre el tema de autocorrelación (consecuencias sobre $\hat{\beta}^{MCO}$, tests y soluciones)

- LDP= BR+12

2011 CD - TOV. (571) - I cos CO2) - 102 E(4-NB) (4-NB) (4-3. (20 puntos) Asuma el modelo $Y = X\beta + \epsilon \operatorname{con} \epsilon \sim N(0, \sigma^2)$. Explique el método de máximo de verosimilitud (ML). Es decir, construya la función de verosimilitud y encuentre \widehat{eta}_{ML} y σ_{ML}^2 . Escriba la matrix de varianzas-covarianzas de \widehat{eta}_{ML} . 4. (20 puntos) Construya la función de verosimilitud para el modelo Probit y para el modelo Logit. Explique brevemente la forma de encontrar los coeficientes $\widehat{\beta}$. 202-2011-XNY-10 Lima, Diciembre 4 del 2010