

1. Dado el siguiente modelo:

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

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:

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

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

$$IP = a + a_0 * ZO + a_1 * Z1 + b_1 * ZO + b_2 * Z1$$

b) Escribir la regresión del modelo propuesto

Resumen

Estadísticas de la regresión

Coeficiente (0.94432452
Coeficiente (0.89174881
R^2 ajustado	0.88308871
Error típico	1455.97498
Observacion	55

ANÁLISIS DE VARIANZA

	Grados de libertad	Suma de cuadrados	Media cuadrática	F	Valor crítico de F
Regresión	4	873147610	218286902	102.972168	1.6907E-23
Residuos	50	105993157	2119863.13		
Total	54	979140766			

	Coeficientes	Error típico	Estadístico t	Probabilidad	Inferior 95%	Superior 95%	Inferior 95.0%	Superior 95.0%
Intercepción	796.150222	1302.17795	0.61139894	0.54370543	-1819.35117	3411.65162	-1819.35117	3411.65162
Variable X 1	0.14260548	0.03548281	4.01900221	0.00019685	0.07133617	0.2138748	0.07133617	0.2138748
Variable X 2	-0.16418006	0.03452341	-4.75561552	1.7186E-05	-0.23352237	-0.09483775	-0.23352237	-0.09483775
Variable X 3	0.49179361	0.12261151	4.01099044	0.00020197	0.24552114	0.73806609	0.24552114	0.73806609
Variable X 4	-0.16195912	0.11636992	-1.391761	0.17015551	-0.39569498	0.07177675	-0.39569498	0.07177675

c) ¿Cuáles son los efectos de corto plazo y de largo plazo? ¿Son estadísticamente significativos? ¿Por qué?

EFFECTO A CORTO PLAZO

$$a_0 = 0.1426$$

EFFECTO A LARGO PLAZO

$$a_1 + a_2 + b_1 + b_2 = 0.308$$

6:45 pm a 7:25 pm

40 Minutos