



## Examen Final

Especialidad de Economía

Econometría 1

2012-I

Profesor: Gabriel Rodríguez

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 Sección 1 (45 puntos)

Defina (brevemente) los siguientes conceptos:

1. Criterios de información SIC (BIC) y AIC.
2. El estadístico  $J$  de Davidson y MacKinnon (para seleccionar modelos)
3. Tres estadísticos para detectar heterocedasticidad
4. Condición de orden y de rango (ecuaciones simultáneas)
5. Modelos Probit y Logit
6. El inverso del ratio de Mills
7. Dos ejemplos de variables dependientes discretas
8. Modelos de Regresión dinámicos
9. Estacionariedad

2 Sección 2 (75 puntos)

1. (25 puntos) Escriba un pequeño reporte (1 a 2 páginas) sobre el tema de autocorrelación (consecuencias sobre  $\hat{\beta}^{MCO}$ , tests y soluciones).
2. (25 puntos) Construya la función de verosimilitud para el modelo Censurado y Truncado, respectivamente. Explique brevemente la forma de encontrar los coeficientes  $\hat{\beta}$ .
3. (25 puntos) Escriba un pequeño reporte (1 a 2 páginas) sobre los procesos TS (Trend Stationary-Estacionario en Tendencia) y DS (Difference Stationary-Estacionario en Diferencias).

Lima, Junio 30 del 2012