**EXAMEN SUSTITUTORIO**

**ECONOMETRIA I**

Con base a la data: Data\_Anual\_Examen.xlsx

1. Suponga que Ud. Intenta ajustar el siguiente modelo de regresión:



Donde:

Tasa de crecimiento de CP

Tasa de crecimiento de Y

1. Asumiendo una estructura de retardos de Koyck estime el efecto de corto y largo plazo.
2. Con base a sus resultados auxiliares determine si existe autocorrelación. Si lo hubiera corrija dicho problema y escriba la regresión.

1. Suponga que Ud. Intenta ajustar el siguiente modelo de regresión:



1. Suponiendo una estructura de retardos aritmética de FISHER estime los parámetros de la regresión.
2. Con base a sus resultados auxiliares determine si existe autocorrelación. Si lo hubiera corrija dicho problema y escriba la regresión.

1. Suponga que Ud. Intenta ajustar el siguiente modelo de regresión:



Utilizando el polinomio:



1. Determine el número de rezagos a utilizar (Ayuda: está asociado al mínimo valor del criterio de Akaike y Schwarz y estime la regresión.
2. Con base a los resultados auxiliares del modelo seleccionado determine si existe autocorrelación. Si lo hubiera corrija dicho problema y escriba la regresión.
3. Suponga el siguiente modelo de ecuaciones simultáneas:

Yt = CPt + CGt + IBt + Xt – Mt

IBt = (IPt –STOCK)+IGt

CPt = a1 + a2Yt

(IPt-STOCKt) = a3 + a4Yt + a5Mt

Mt = a6 + a7TIt + a8Yt + a9RINt

Utilizando la información contenida en: Data\_Anual\_Examen transforme el modelo con base a una relación en sus tasas de crecimiento y:

1. Estime los parámetros estructurales del modelo mediante el método de mínimos cuadrados de dos etapas.
2. Con base al modelo estimado y además suponiendo que las variables exógenas evolucionan según su tendencia (1950-2018), mediante una simulación obtenga la tasa de crecimiento de nuestra economía en el 2019 y 2020.