**Práctica 1**

**Econometría I**

**Software a utilizar: EXCEL**

**FERNÁNDEZ NÚÑEZ, YURI DAVID.**

1. Dado el siguiente modelo:

De acuerdo a la propuesta de Koyck y con base a la data Practica 1\_Econometría I

1. ¿Cuál es el efecto de corto plazo y de largo plazo?

Hacemos la regresión del modelo autorregresivo en Eviews



Donde obtenemos el Bo

**efecto de corto plazo**

Considerando delta = 0.5

Tenemos el efecto de largo plazo

1. ¿Cuál es el tiempo requerido para la primera mitad, o 50%, del cambio total ocurrido en el CP como consecuencia de un cambio unitario sostenido en el PBI?

**En primer trimestre el efecto es de 50% sobre CONSUMO PRIVADO de un cambio unitario en PBI por tanto el efecto se siente inmediatamente.**

1. Según la prueba h de Durbin, ¿Existe autocorrelación? ¿Y según la prueba de Breusch y Godfrey cuál es su conclusión? ¿Por qué?
2. Dado el siguiente modelo:

De acuerdo a la propuesta de Almon y con base a la data Practica 1\_Econometría I

Corto plazo

1. ¿Cuál es el efecto de corto plazo y de largo plazo?

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 2128.93448 | Alfa |
| **B =** | 0.57468597 | a0 |
|  | -0.70938098 | a1 |
|  | 0.18524656 | a2 |

**Por tanto, el multiplicador de corto plazo es:**

**Largo plazo**

**El efecto de largo plazo es la suma de las betas**

**Por tanto:**

1. ¿Al efecto de corto plazo que porcentaje del efecto total le corresponde?

**Por tanto, el efecto a corto plazo es 11.36%**

1. ¿Existe autocorrelación en la regresión auxiliar? ¿Por qué?
2. Dado el siguiente modelo:

Con base a la data Practica 1\_Econometria I, ¿Cuál es la dirección de la causalidad según la Prueba de Granger