Examen sustitutorio

Econometría I

1. Dado el siguiente modelo:

De acuerdo a la propuesta de Almon y suponiendo polinomio de primer grado, con base a la data Data1\_Examen sustitutorio

1. Deducir el modelo a estimar

1. Escribir la regresión del modelo propuesto
2. ¿Cuáles son los efectos de corto plazo y de largo plazo? ¿el efecto de corto plazo es estadísticamente significativo? ¿Por qué?

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Resumen |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
| *Estadísticas de la regresión* | |  |  |  |  |  |
| Coeficiente de correlación múltiple | 0.944324524 |  |  |  |  |  |
| Coeficiente de determinación R^2 | 0.891748806 |  |  |  |  |  |
| R^2 ajustado | 0.883088711 |  |  |  |  |  |
| Error típico | 1455.974976 |  |  |  |  |  |
| Observaciones | 55 |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
| ANÁLISIS DE VARIANZA | |  |  |  |  |  |
|  | *Grados de libertad* |  | *Suma de cuadrados* | *Promedio de los cuadrados* | *F* | *Valor crítico de F* |
| Regresión | 4 |  | 873147609.5 | 2.18E+08 | 102.9722 | 1.69E-23 |
| Residuos | 50 |  | 105993156.6 | 2119863 |  |  |
| Total | 54 |  | 979140766.1 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | *Coeficientes* |  | *Error típico* | *Estadístico t* | *Probabilidad* | *Inferior 95%* |
| Intercepción | 796.1502225 |  | 1302.177955 | 0.611399 | 0.543705 | -1819.35 |
| Z0 | 0.142605483 |  | 0.035482808 | 4.019002 | 0.000197 | 0.071336 |
| Z1 | -0.164180059 |  | 0.034523409 | -4.75562 | 1.72E-05 | -0.23352 |
| Z2 | 0.491793612 |  | 0.122611514 | 4.01099 | 0.000202 | 0.245521 |
| Z3 | -0.161959116 |  | 0.11636992 | -1.39176 | 0.170156 | -0.39569 |