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

Con base a la data Data1\_Examen sustitutorio y utilizando el EXCEL ¿Cuál es la dirección de la causalidad según la Prueba de Granger?

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Resumen |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| *Estadísticas de la regresión* | |  |  |  |  |
| Coeficiente de correlación múltiple | 0.81220221 |  |  |  |  |
| Coeficiente de determinación R^2 | 0.65967243 |  |  |  |  |
| R^2 ajustado | 0.61622636 |  |  |  |  |
| Error típico | 2570.9589 |  |  |  |  |
| Observaciones | 54 |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| ANÁLISIS DE VARIANZA |  |  |  |  |  |
|  | *Grados de libertad* | *Suma de cuadrados* | *Promedio de los cuadrados* | *F* | *Valor crítico de F* |
| Regresión | 6 | 602170307 | 100361718 | 15.1837071 | 1.4164E-09 |
| Residuos | 47 | 310661995 | 6609829.68 |  |  |
| Total | 53 | 912832302 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | *Coeficientes* | *Error típico* | *Estadístico t* | *Probabilidad* | *Inferior 95%* |
| Intercepción | 4187.76687 | 2339.34196 | 1.79014737 | 0.07987319 | -518.3821328 |
| IP-1 | 1.15311237 | 0.31668749 | 3.64116805 | 0.00067458 | 0.516019317 |
| IP-2 | -0.44221857 | 0.29790871 | -1.48440968 | 0.1443765 | -1.041533582 |
| IP-3 | 0.13067007 | 0.28156062 | 0.46409215 | 0.64472421 | -0.435756831 |
| PBIR-1 | -0.12145676 | 0.10384196 | -1.16963083 | 0.24804697 | -0.330359851 |
| PBI-2 | 0.0205523 | 0.08491785 | 0.24202565 | 0.80981324 | -0.150280383 |
| PBIR-3 | 0.09839439 | 0.09861595 | 0.99775331 | 0.32350835 | -0.099995309 |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Resumen |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| *Estadísticas de la regresión* | |  |  |  |  |
| Coeficiente de correlación múltiple | 0.91087147 |  |  |  |  |
| Coeficiente de determinación R^2 | 0.82968684 |  |  |  |  |
| R^2 ajustado | 0.80794473 |  |  |  |  |
| Error típico | 7678.24341 |  |  |  |  |
| Observaciones | 54 |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
| ANÁLISIS DE VARIANZA |  |  |  |  |  |
|  | *Grados de libertad* | *Suma de cuadrados* | *Promedio de los cuadrados* | *F* | *Valor crítico de F* |
| Regresión | 6 | 1.3499E+10 | 2249760802 | 38.1603716 | 1.8798E-16 |
| Residuos | 47 | 2770904826 | 58955421.8 |  |  |
| Total | 53 | 1.6269E+10 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | *Coeficientes* | *Error típico* | *Estadístico t* | *Probabilidad* | *Inferior 95%* |
| Intercepción | 11241.1775 | 6986.51269 | 1.60898262 | 0.1143175 | -2813.873128 |
| IP-1 | 1.87730594 | 0.94579639 | 1.98489438 | 0.05301014 | -0.025390973 |
| IP-2 | -3.00151929 | 0.889713 | -3.37358146 | 0.00149418 | -4.79139098 |
| IP-3 | 1.25770465 | 0.84088896 | 1.49568457 | 0.14142091 | -0.433945747 |
| PBIR-1 | 0.06049076 | 0.31012704 | 0.19505156 | 0.84619334 | -0.563404374 |
| PBI-2 | 0.76116194 | 0.25360963 | 3.00131329 | 0.00429358 | 0.250965183 |
| PBIR-3 | 0.06673099 | 0.29451939 | 0.22657588 | 0.82173611 | -0.525765601 |

**¿Cuál es la dirección de la causalidad según la Prueba de Granger?**

Sumatoria de alfas: 0.84156388

Sumatoria de betas: -0.00251008

* Existe una causalidad bilateral

Sumatoria de landas: 0.8883837

Sumatoria de deltas: 0.13349129

* Existe una causalidad bilateral