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?

1. Dado el siguiente modelo y con base a la data: Data2\_Examen sustitutorio

Yt = CPt + CGt + IBt + Xt – Mt

IBt = IPt + IGt + STOCKt

CPt = a1 + a2Yt + a3CPt-1 [3]

IPt = a4 + a5 Yt + a6Mt [4]

Mt = a7 + a8TIt + a9Yt + a10RINt + a11CGt [5]

Estime la ecuación [4] por el método de mínimos cuadrados de dos etapas utilizando matrices en el software excel.

Primero estimamos la Yt para reemplazar en la ecuación (4)