**I EXAMEN**

**ECONOMETRIA I**

1. I. Suponga que Ud. Pretende conocer la relación de largo plazo que existe entre las importaciones y los términos de intercambio de nuestra economía. Con base a la data consignada en Data\_Examen parcial.

Determine:

1. El efecto de largo plazo de los términos de intercambio sobre las importaciones
2. El efecto de los términos de intercambio esperado sobre las importaciones
3. El efecto de los términos de intercambio sobre las importaciones deseadas.

Para obtener su respuesta observe la existencia de autocorrelación y corrija tal problema.

1. ¿Cree Ud. que existe simultaneidad, según Granger, entre los términos de intercambio y las importaciones? ¿Por qué? Obtenga su respuesta con base a 10 rezagos.
2. ¿Qué sucede con su respuesta en a) si utiliza el método de variables instrumentales propuesta por Liviatan?
3. ¿Cuál sería su respuesta en a) si utiliza el método de almon?

1. Suponga el siguiente modelo de ecuaciones simultáneas:

Yt = CPt + CGt + IBt + Xt – Mt

IBt = IPt + IGt + STOCKt

BCt = Xt - Mt

CPt = a1 + a2Yt + a3CPt-1

IPt = a4 + a5Yt-1 + a6Mt + a7IPt-1

Mt = a8 + a9TIt + a10Yt + a11RIN

Utilizando la información contenida en: Data\_Examen parcial.

1. Estime los parámetros estructurales del modelo mediante el método de mínimos cuadrados de dos etapas.
2. Según la teoría económica y la significancia individual evalúe los resultados y determine el modelo estructural apropiado a utilizar.
3. Suponiendo que los próximos 3 años las RIN aumentarán en 15%, los TI en 14% y las X en 18%. Además, considere que las variables exógenas internas evolucionaran según las siguientes tasas de crecimiento:

* CG = 0.3%
* IG = 0.5%
* STOCK = 1%

Con el modelo propuesto, ¿Cuál es la tasa de crecimiento promedio anual de nuestra economía en los próximos 3 años? ¿Y el resultado de la balanza comercial?

1. Suponiendo que los próximos 3 años las RIN disminuyeran en 15%, los TI en 14% y las X en 18%. Además, considere que las variables exógenas internas evolucionaran según las siguientes tasas de crecimiento:

* CG = 13%
* IG = 25%
* STOCK = 5%

Con el modelo propuesto, ¿Cuál es la tasa de crecimiento promedio anual de nuestra economía en los próximos 3 años? ¿Y el resultado de la balanza comercial?