EXAMEN DE APLAZADOS

ESTADÍSTICA PARA ECONOMISTAS II

1. Considérese el siguiente modelo:

Y = a + b X2 + c X3 + u

Y con los datos contenidos en el archivo: Data1\_Analisis de sensibilidad

Donde:

Y = Demanda de dinero real (Money) en Miles de nuevos soles (1994=100)

X2 = (interest) Tasa de interés

X3 = Producto Bruto Interno Real (GNP) Miles de nuevos soles (1994=100)

1. Obtenga la regresión del modelo propuesto e Interprete sus resultados
2. ¿El ajuste lineal de la regresión anterior es apropiada? ¿por qué?
3. En algún periodo ¿Existe cambio estructural? ¿Por qué?
4. Si hubo cambio estructural, ¿Esta se debió debido al coeficiente independiente, a la pendiente o a ambos?
5. Realice una estimación por intervalos para el coeficiente de X2 considerando un nivel de significancia del 10%.
6. Realice una estimación por intervalos para la varianza de la regresión utilizando un nivel de significancia del 1%.
7. Considérese los datos contenidos en el archivo: Data2\_Autocorrelacion. Supóngase que desea ajustar el modelo:



1. Con un nivel de significancia del 1% ¿Existe autocorrelación según la prueba de aleatoriedad? ¿Por qué?
2. Con un nivel de significancia del 5% ¿Existe autocorrelación según la prueba de Durbin Watson? ¿Por qué?
3. Con un nivel de significancia del 10% ¿Existe autocorrelación según la prueba de Breusch y Godfrey? ¿Por qué?
4. Basado en la prueba anterior considere eliminar la presencia de autocorrelación mediante el método de MCGF.