**EXAMEN DE APLAZADOS**

**ESTADISTICA PARA ECONOMISTAS II**

1. Interprete técnicamente el siguiente resultado:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| White Heteroskedasticity Test: | | | |
| F-statistic | 9.412143 | Probability | 0.000000 |
| Obs\*R-squared | 118.0411 | Probability | 0.000000 |

Y este otro.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test: | | | |
| F-statistic | 4.003157 | Probability | 0.023715 |
| Obs\*R-squared | 7.630266 | Probability | 0.022035 |

1. Comente esta frase: “Dado que la corrección de los problemas de autocorrelación y heterocedasticidad afecta a la eficiencia (no al sesgo) si en un modelo estimado con MCO los parámetros son ya estadísticamente muy significativos no merece la pena corregir autocorrelación y heterocedasticidad, porque la mejora en la eficiencia no es necesaria”
2. Si un modelo estimado por MCO tiene autocorrelación AR(1) con un DW=0.6, cómo transformaría los datos para corregir el problema con MCGF.
3. Comente esta frase: “En la práctica, y en previsión de problemas con la perturbación, utilizar por defecto el estimador MCG es siempre recomendable, dado que frente a MCO, MCG es siempre eficiente.
4. ¿Qué ventaja ofrece el test LM de Bresch – Godfrey frente al test de DW?
5. Considérese el siguiente modelo:

IMPK = a + b GTO + u

Y con los datos contenidos en el archivo: Data\_Examen de aplazados.

1. ¿Los residuos de la regresión anterior tienen una distribución normal?
2. ¿El ajuste lineal de la regresión anterior es correcta según la prueba de linealidad?
3. En 1994.2 ¿Existe cambio estructural según la prueba de Chow?
4. Considere evaluar la probable existencia de cambio estructural utilizando variables dummy. ¿Existe cambio estructural?
5. Pruebe la significancia individual y global del modelo ajustado utilizando un nivel de significancia del 1%
6. Interprete el resultado de la bondad de ajuste
7. Si en los próximos 2 años en cada trimestre el GTOHOGK aumentará en 5% ¿Cuál es el pronóstico de IMPK con base a la regresión ajustada?
8. Si cada observación del GTOHOGK aumenta en 10% ¿Qué sucede con el intercepto de la regresión ajustada? ¿Y con la pendiente?
9. Realice una estimación por intervalos para el coeficiente de GTOHOGK considerando un nivel de significancia del 5%.
10. Realice una estimación por intervalos para la varianza de la regresión utilizando un nivel de significancia del 1%.