**EXAMEN FINAL**

**ESTADÍSTICA PARA ECONOMISTAS II**

1. Considérese los datos del periodo 1996.05 a 2004.08 contenidos en el archivo: Data1\_Examen Final. Supóngase además que se desea ajustar el modelo:



Donde:

Importaciones totales (Millones de $, 2004=100)

Índice del Tipo de cambio bilateral (2004=100)

Gasto de Gobierno Corriente (Millones de S/. 2004=100)

Índice del PBIR (2004=100)

Reservas Internacionales Netas (Millones de $, 2004=100)

Crédito al Sector Privado Real (Millones de S/. 2004=100)

1. Escriba la regresión ajustada por el MMCO e Interprete sus resultados con base a consideraciones teóricas y estadísticas
2. ¿La especificación matemática del modelo es apropiada? ¿Por qué?
3. ¿Qué variables considera que son redundantes? ¿Por qué?
4. Si omitimos el CSP ¿Es apropiado? ¿por qué?
5. Según la prueba de redundancia y/o omisión ¿Cuál es el modelo ajustado apropiado?
6. Sobre la base de su modelo ajustado anterior ¿Según los residuos recursivos existe estabilidad? ¿Por qué? Realice una prueba formal para establecer en que año (s) existe un cambio estructural.
7. Utilizando el test de Wald pruebe las siguientes hipótesis:

* 
* 



* 





1. Sobre la base de la pregunta e) Asumiendo un nivel de significancia de 1%, 5% y 10% ¿Existe autocorrelación?

Regresionar, view, residual test, serial correlation LM, NUMERO.

1. Considerando los mismos niveles de significancia según Breusch-Godfrey ¿Existe autocorrelación? ¿De qué orden? ¿Por qué?
2. Asumiendo un nivel de significancia del 5% estime el modelo utilizando el método de tres pasos de Cochrane-Orcutt.
3. Si el nivel de significancia es del 10% ¿Qué sucede con nuestras estimaciones si el método es de Durbin de dos pasos?
4. Si ahora proponemos, a diferencia del modelo original, un modelo doble logarítimo ¿Qué modelo es el apropiado según la bondad de ajuste pertinente? ¿Por qué?