

Fuente: Examen Parcial de Econometría II 2021

3. (30 puntos) Verdadero, Falso, o Incierto (sólo se corregiran respuestas con justificación)

- **(a) (15 puntos)** Conforme a la siguiente información:

Regresión	SSR	Rezagos
x contra rezagos de x	0.055	2
x contra rezagos de x y z	0.043	2,2
z contra rezagos de z	0.021	2
z contra rezagos de x y z	0.019	2,2

y una muestra de 39 observaciones, existe evidencia de bicausalidad a la Granger.

- **(b) (15 puntos)** Considere el modelo $y_t = \bar{\beta}t^3 + u_t$. Entonces

$$T^{-7/2}(\hat{\beta} - \bar{\beta}) \xrightarrow{D} N(0, 7\sigma^2) \quad (1)$$

Recuerde que $T^{-\nu-1} \sum_{t=1}^T t^\nu \rightarrow (\nu+1)^{-1}$.