

**Fuente: Examen Parcial de Econometría II 2021**

**4. (15 puntos)** Evalúe si las aseveraciones que siguen son verdaderas, falsas o inciertas. Justifique su respuesta.

- **(a) (5 puntos)** La hipótesis nula en el test de causalidad a la Granger es que  $\psi$  no precede estadísticamente a  $\xi$ .
- **(b) (5 puntos)** El proceso:

$$\psi_\tau = (1 + \rho)\psi_{\tau-1} - \rho\psi_{\tau-2} + u_\tau + \alpha u_{\tau-2} \quad (1)$$

con  $0 < \rho < 1$  y  $\alpha > 1$  es débilmente estacionario.

- **(c) (5 puntos)** En el proceso:

$$\psi_\tau = \rho_\tau + u_\tau \quad (2)$$

se tiene que  $T(\hat{\rho} - \rho) \xrightarrow{D} 0$ .