

# Econometría II

Profesor: Rómulo A. Chumacero

## Práctica 3

1. (100 puntos) El archivo `base_25.xls` de la Práctica 1 contiene información mensual del IMACEC ( $Y$ ), IPC ( $P$ ) y Tasa de Política Monetaria ( $I$ ). Considere las series  $\ln(P_t)$ ,  $\ln(Y_t)$ ,  $\Delta \ln(P_t)$ ,  $\Delta \ln(Y_t)$ ,  $i_t = I_t/100$ .
  - a) Aplique los tests de estacionariedad discutidos en clases a cada una de las 5 series y determine su orden de integración.
  - b) Discuta las implicancias económicas (si existen) de sus resultados.
2. Para la fecha de presentación, cada grupo debe preparar dos presentaciones de 5 minutos cada una (en PowerPoint o PDF) que no necesita entregar a los ayudantes de:
  - a) Los resultados de la pregunta 1.
  - b) Resumen y discusión de los puntos más importantes del paper de Camalan et al. (2025).
3. Leer (sin preparar presentación) el paper de Bhardwaj y Swanson (2006) y Sims y Uhlig (1991).

### **Fechas relevantes:**

- **Tarea:** Entregar un informe de la tarea en un archivo PDF junto con los programas computacionales desarrollados en mail a los ayudantes hasta las 8:00 am del 9 de septiembre.
- **Presentaciones:** Las presentaciones de la pregunta 2 se realizarán el 9 de septiembre en horario de clases.
- **Control:** El control del tópico se realizará el 4 de septiembre a las 8:00.
- **Informe de avance:** El informe de avance debe entregarse hasta las 8:00 del 4 de septiembre, utilizando la plataforma Gradescope.