

Bono Reto 1. Haciendo Macroeconomía

Econometría II

Programa de Economía

Universidad EAFIT

2025-II

Profesor: Gustavo A. García

PONER EL SIGUIENTE NOMBRE A LOS ARCHIVOS:

apellido1_apellido2_apellido3_apellido4_BonoReto1

Subir todos los archivos juntos (.qmd y html (o pdf o docx)) en un ZIP o comprimido (con el mismo nombre mencionado anteriormente) en Interactiva/Buzón/Bono Reto 1

Fecha de entrega: viernes 8 de agosto a las 12 del medio día

En este ejercicio se busca determinar el proceso generador de datos ARIMA de la serie de tiempo de la inflación anualizada construida para el Reto 1. La entrega de este ejercicio se puede realizar en los grupos que ya están trabajando en el Reto 1 o de forma individual. El análisis econométrico debe incluir:

- gráfico de la serie de tiempo
- correlograma
- pruebas de raíz unitaria (todas)
- transformar la serie a estacionaria (si es necesario)
- correlogramas y pruebas de raíz unitaria a la serie estacionaria (con el Dick-Fuller aumentado es suficiente)
- identificación de las posibles estructuras ARIMA (definir al menos 3 estructuras)
- predicción del modelo ARIMA seleccionado

El documento final debe ser entregado en un Quarto o en otro formato, donde se reporte el código utilizado, los resultados y las interpretaciones. Es importante que las interpretaciones se hagan con sentido económico, utilizando la teoría macroeconómica y/o microeconómica para explicar los resultados.

Los criterios de evaluación incluye:

- el código
- edición de los resultados
- las interpretaciones

Al ser un bono sobre el Reto 1, esta entrega la realiza las personas/grupos que así lo desean, es decir, que no es obligatoria. La bonificación máxima será de 0.7 adicional sobre la calificación del Reto 1.