

Trabajo práctico nro. 2 de Econometría

Universidad de Buenos Aires
Prof. Gabriel V. Montes-Rojas

Pregunta 1: Pronósticos de inflación

Construya una serie de inflación mensual usando distintas fuentes tal como considere necesario para armar una serie empalmada y continua para el periodo 2004-2022 (use hasta abril 2022, el último dato disponible). Dado que en el periodo hubo varios índices de precios alternativos (INDEC, IPC Congreso, etc.) deberá argumentar cómo y por qué construye cada serie.

1. Grafique la serie y realice un análisis estadístico para determinar raíces unitarias, el orden de integración, y la presencia de estacionalidad. Para las preguntas siguientes deberá trabajar sobre la serie sin tendencia y desestacionalizada.
2. Elija el mejor modelo para la inflación (desestacionalizada y sin tendencia). Justifique.
3. Estime un modelo para 2004-2021 y evalúe la predicción del mismo para la inflación de enero a abril 2022. Nota: a la predicción tiene que agregarle luego la tendencia y estacionalidad (si hubiere) que quitó en el punto anterior.
4. Realice un pronóstico para la inflación de todo 2022. Nota: a la predicción tiene que agregarle luego la tendencia y estacionalidad (si hubiere) que quitó en el punto anterior.
5. Evalúe la presencia de cambios estructurales a partir de marzo 2020. ¿Qué puede decir sobre el efecto de la pandemia de COVID-19?