



UNIVERSIDAD
AUSTRAL

ECONOMETRIA

Trabajo Práctico Nº 3

Fecha de entrega: 10 de diciembre de 2021

Prof. Vanesa D'Elia

Prof. Andrés Gallo

Utilice la base de datos educ.dta colgada en la página web del curso. En esta base encontrará variables para estimar como impactan las variables educación (x_1) y preferencias políticas (x_2) en el nivel de autonomía fiscal (y) (Aclaración: lo importante en este ejercicio es concentrarse en la econometría y no en la intuición económica. La información fue generada y no corresponde a un caso real. La misma está presentada como diferencias de un caso testigo, por lo que encontrará valores positivos y negativos).

a) Corra la siguiente regresión OLS: $y = a + b_1 \cdot x_1 + b_2 \cdot x_2 + e$

b) Compare los errores estándares de OLS con los errores estándares robustos de White vistos en clase (Ayuda: comandos útiles son reg, reg ..., robust, y vce) ¿qué puede concluir a partir de los resultados?

c) Utilice el test de White para heteroscedasticidad y el test de Breush y Pagan, ¿qué conclusión obtiene?

d) Utilice ahora el test de Goldfeld y Quandt. Para hacer este test tienen que dividir la muestra en dos. Primero utilicen educación y luego nivel de autonomía fiscal (ordene la muestra por la variable que quiere utilizar para separarla, y luego divida la muestra).

e) Estime nuevamente su regresión utilizando mínimos cuadrados ponderados y compare sus resultados con los obtenidos anteriormente. ¿Qué método es más apropiado? Comente.