

PUBLICACIONES DE 4^{er} CURSO

Curso: 4º

Grado: Economía

Asignatura: ECONOMETRÍA III

PARTE 3: MODELOS DE SERIES TEMPORALES

ENUNCIADO EJERCICIO EMPIRICO 2

Profesores: Antonio Aznar y M^a Isabel Ayuda

Departamento de ANÁLISIS ECONÓMICO

Curso Académico 2015/16



**Facultad de
Economía y Empresa
Universidad Zaragoza**

El fichero INFLACION2.XLS obtenido del libro de Stock y Watson (2012) contiene datos mensuales desde 1960:1 hasta 2009:12 de dos variables I_{IPC} (en este ejercicio la llamaremos Y) que es la tasa de inflación mensual anualizada de los precios basada en el Índice de Precios al Consumo, IPC y la variable I_{DGCP} (en este ejercicio la llamaremos X) que es la tasa mensual anualizada de inflación de los precios basada en el Deflactor del Gasto del Consumo Personal, $DGCP$.

Con estos datos, seguir las pautas dadas en clase para especificar, estimar, contrastar y utilizar un modelo econométrico.