

Taller #10
Autocorrelación
Respuestas Sugeridas
Econometría 06216

Profesor: Julio César Alonso
Monitora: Stephanie Vergara
Mauricio A. Arcos

Notas:

- Recuerde que sólo dos preguntas, seleccionadas al azar, serán calificadas.
- Este taller es para ser entregado en los primeros 10 minutos de la clase del próximo **11 de Abril**.

INSTRUCCIONES:

- Este taller debe ser escrito en computador y entregado en papel.
- Cuando sea posible, debe mostrar el procedimiento efectuado para llegar a sus resultados.

En un pequeño país (el mismo del taller anterior) se recogió información de la formación bruta de capital (FBC) y del producto interno bruto a precios del mercado (PIBPM, ambas variables están medidas en millones de dólares del año 1986. (La información se encuentra disponible en el archivo T10-01-05.xls). Usted, ha sido contratado para realizar un estudio sobre el comportamiento de la inversión en dicho pequeño país.

1. De acuerdo a la información anterior:
 - a) Establezca un modelo que le permite estudiar el comportamiento de la inversión, explicada linealmente por el producto interno bruto a precios constantes
 - b) Estime el modelo anterior y repórtelo.
 - c) Grafique los errores estimados y comente dicha grafica
2. Continuando con la pregunta anterior,
 - a) Efectúe la prueba rachas mostrando las hipótesis a probar, el estadístico empleado y la decisión.
 - b) Efectúe la prueba de Durbin-Watson mostrando claramente las hipótesis a contrastar, el estadístico y la decisión
 - c) Efectúe la prueba de Box-Pierce o Ljung-Box, mostrando claramente las hipótesis a contrastar, el estadístico empleado y la decisión.
3. Resuelva el problema de Autocorrelación (si existe) e interprete los coeficientes del modelo libre de problemas.