

Guía de ejercicios N.3
E15552: Política Económica
Profesor: Ernesto Bernal Martínez

Datos: Están contenidos en el archivo <VARPIBQ.XLS>, que contiene información sobre las siguientes variables para el periodo 1990q1 – 2011q4, con periodicidad trimestral: CGOB (consumo del gobierno), CHOG (consumo de hogares), INV (FBKF + variación de existencias), VEX (variación de existencias), FBKF, EXPO (exportaciones), IMPO (importaciones), PIB, M1 e IPC (Índice de Precios al Consumidor).

Modelos ARIMA: Utilice la variable PIB.

- a) Transforme la serie en logaritmos naturales, en primera y segunda diferencia y analice las propiedades de estacionariedad.
- b) Complemente el análisis anterior con contrastes de raíz unitaria. Compare y analice los resultados.
- c) Para la serie identificada como estacionaria, identifique los procesos ARIMA×SARIMA mediante el análisis del correlograma. Estime cada modelo para el periodo 1990Q1 – 2010Q4.
- d) Evalúe las propiedades de los residuos utilizando los contrastes estadísticos que considere pertinentes, ¿son ruido blanco?.
- e) Elija el modelo con las mejores propiedades estadísticas utilizando los criterios de información (Akaike, Schwarz y Hanan-Quin).
- f) Realice pronósticos puntuales y del intervalo de confianza fuera de la muestra para el periodo 2012Q1 – 2013Q4. Calcule la tasa de crecimiento interanual y analice los resultados considerando las perspectivas del gobierno y las predicciones de organismos internacionales.