

Práctica 10: Autocorrelación III

Aula: 24

Con los datos anuales 1950-1982 de los EEUU del archivo “inv.txt”, estime el modelo

$$\log Y_t = \beta_1 + \beta_2 \log X_t + u_t$$

donde Y = inventarios y X =ventas, medidas en miles de millones de dólares.

1. Estime la regresión anterior.
2. Investigue si hay autocorrelación positiva mediante la prueba de Durbin-Watson.
3. Si ρ es positivo, contraste la hipótesis.

$$H_0 : \rho = 1$$

4. Estimar el modelo anterior con MCGF, utilizando la transformación según los resultados de los apartados anteriores.
5. Contraste si la elasticidad inventarios-venta es unitaria.