

Práctica 9: Autocorrelación II

Aula: 24

El archivo “lab9.gdt” contiene los siguientes datos trimestrales de la economía de Estados Unidos (1975-2000): nivel de dinero (M1), PIB real y el índice de precios al consumidor (CPI). Considere el siguiente modelo de demanda de dinero:

$$M1_t = \beta_1 + \beta_2 \ln PIB_t + \beta_3 \ln CPI_t + u_t,$$

$$u_t \sim i.i.d.N(0, \sigma^2)$$

1. Estime bajo Mínimos Cuadrados Ordinarios. ¿Los signos de los parámetros son los esperados?
2. Guarde los residuos de esta regresión y grafíquelos con respecto al tiempo. ¿Qué observa en esta gráfica?
3. Ahora haga la gráfica con las variables \hat{u}_t y \hat{u}_{t-1} . ¿Qué observa?
4. Haga la prueba de Durbin-Watson. ¿Cuál es su conclusión?
5. En caso de que haya autocorrelación, estime el coeficiente de autocorrelación.