

UNIVERSIDAD NACIONAL AUTONOMA DE MEXICO

FACULTAD DE ECONOMIA

EXAMEN EXTRAORDINARIO ECONOMETRIA II

PROFR- GUERRERO FLORES ALEJANDRO

1. En el siguiente modelo identifique las ecuaciones, si están exactamente identificadas, sobre identificadas o sub identificadas.

a) $W = a_0 + a_1P + a_2Q$

b) $P = b_0 + b_1W$

Donde W = salarios por hora del sector no agrícola

P = INPC (Índice Nacional de Precios al Consumidor)

Q = Producción por hora del sector no agrícola

Y = PNB (Producto Nacional Bruto, 2000 – 2009)

Encuentre la forma reducida, los coeficientes ($\Pi = \Pi_i$).

Analice si tiene solución única o no.

2. En el siguiente modelo, si se dispone de tantas observaciones como variables y parámetros estimados, es decir, que si $T = k$, ($n = k$), y se dispone exactamente de tantas observaciones muestrales como variables explicativas en el modelo (incluyendo la posible constante), se tendrá entonces que la matriz (k), es de orden ($k * k$) y por tanto, si no hay multicolinealidad, dicha matriz es invertible y se cumple entonces que

$$\hat{\beta} = (x'x)^{-1} x'y = x^{-1} (x')^{-1} x'y = x^{-1} y$$

Compruebe el hecho de que

$$x^{-1} (x')^{-1} x'y = x^{-1} y$$

Con los elementos de la matriz siguiente

	x		y
1	9	10	6
1	10	13	8
1	8	11	8

3. ¿Cuáles son las propuestas básicas de la Econometría Bayesiana?
4. Defina la diferencia entre una relación estadística y una determinística
5. Analice el modelo económico prototipo keynesiano
 - a) $C_t = \gamma_1 Y_t + \beta_1 + e_t^C$ este último término representa el error de la regresión del consumo.
 - b) $I_t = \gamma_2 Y_t + \beta_2 Y_{t-1} + \beta_3 + e_t^I$
 - c) $Y_t = C_t + I_t + G_t$

Plantee el modelo en su forma reducida con los coeficientes (π), y proponga soluciones alternas para el mismo.

BIBLIOGRAFIA BASICA.

- 1.- Damodar, Gujarati. Econometría. México 2004. Edit. Harla, 4ª edición, 971 pp.
- 2.- Salvatore, Dominick. Econometría. México 1990. Edit. McGraw Hill, colección Schaum, 201 pp.
- 3.- D. Intriligator, Michael. Modelos Econométricos. Técnicas y aplicaciones. México 1990. Edit. Fondo de Cultura Económica, 700 pp.
- 4.- Maddala G. S. Introducción a la Econometría. México 2ª edición 1998. Edit. Prentice Hall, 715 pp
- 5.- Green, William. H. Análisis Econométrico. 3ª Edición. Prentice Hall Iberia, Madrid. 1998.
- 6.- Maddala, A. Econometría. Editorial Harla.

7.- Salvatore, Dominick. Econometría. Editorial McGraw Hill, colección Schaum. 1990.