



Nombre y Apellidos:

DNI: Grupo:

Nombre de la serie analizada:

Dirección de descarga de los datos: <https://www.ugr.es/~romansg/material/WebEco/05-Eco3/Ordenador/datos.rar>

Examen con el software econométrico GRET

Se pide responder de **forma razonada** a las siguientes cuestiones:

1. (2 puntos) ¿Es el proceso estacionario en media? ¿Y en varianza?
2. (1/2 punto) ¿Hay componente estacional?
3. (1 1/2 puntos) Proponer 3 modelos para la serie.
4. (2 puntos) Seleccionar uno de los modelos anteriores. ¿Por qué el modelo seleccionado es válido?
5. (1 1/2 puntos) Escribir la ecuación del modelo.
6. (1 1/2 puntos) Estimar el modelo seleccionado sin tener en cuenta las últimas 3 observaciones, ¿cuáles serían las predicciones puntuales y por intervalo para las mismas? Al compararlas con las verdaderas observaciones, ¿qué error se estaría cometiendo en cada una?
7. (1 punto) Para el modelo estimado teniendo en cuenta todas las observaciones, ¿cuáles serían las predicciones puntuales y por intervalo para los 3 primeros periodos futuros?

NOTA: Las preguntas 5, 6 y 7 sólo serán evaluadas en el caso de que el modelo propuesto en la pregunta 4 sea válido.

Tiempo disponible: 1 hora.

Normas para un correcto desarrollo del examen:

- Es recomendable que cada alumno se presente con un ordenador portátil.
- Dicho ordenador debe tener habilitada la conexión a internet a la red UGR. Para más detalles visitar la web <https://csirc.ugr.es/informatica/RedUGR/CVI/eduroam-conf.html>.
- También ha de tener instalado el software econométrico GRET. Dirección de descarga <http://gretl.sourceforge.net/win32/> o <http://gretl.sourceforge.net/osx.html>.
- Se recomienda usar un explorador de internet como Firefox Mozilla (<https://www.mozilla.org/es-ES/firefox/new/>) para descargar los datos desde internet en caso de ser necesario.
- Para los correlogramas usar m retardos.