

## CURSO DE ECONOMETRÍA BÁSICA

### TALLER PRÁCTICO N° V VALIDACIÓN DE SUPUESTOS ECONOMÉTRICOS (PARTE I)

Con base en **Gujarati & Porter (2010)** se pide:

a) Ejercicios argumentativos:

- Supuesto de no multicolinealidad: 10.12 (pg. 354).
- Supuesto de homoscedasticidad: 11.1 (pg. 401).
- Supuesto de no autocorrelación: 12.1, 12.2 y 12.3 (pg, 453 – 454).

b) Ejercicios demostrativos:

- Deducción matemática de mínimos cuadrados ponderados (pg. 409).
- Deducción matemática de errores estándar robustos de White (pg. 411).
- Supuesto de no autocorrelación: 12.15 (pg, 458).

c) Pruebas de especificación econométrica

Explicar las metodologías de pruebas formales para validar la correcta especificación de un modelo econométrico respondiendo a la pregunta: ¿en qué consiste cada prueba de especificación? (se preguntará en el examen final)

1. Pruebas de estacionariedad para series de tiempo.

Especificación en niveles y primera diferencia según series con: a) con rumbo; b) con rumbo y tendencia determinista; c) sin rumbo y sin tendencia.

- ✓ Dickey-Fuller Aumentada.
- ✓ Phillips – Perron.

- ✓ KPSS.
- 2. Normalidad de Residuos
  - ✓ Prueba de Jarque-Bera.
- 3. No correlación serial o no autocorrelación.
  - ✓ Prueba de Breusch-Godfrey multiplicador de Lagrange (LM).
  - ✓ Prueba Durbin-Watson.
- 4. No heteroscedasticidad
  - ✓ Prueba de efecto ARCH.
  - ✓ Prueba de Harvey.
  - ✓ Prueba de Glejser.
  - ✓ Prueba de White.
- 5. No multicolinealidad
  - ✓ Altas correlaciones parciales.
  - ✓ Inflación de varianza.
- 6. Estabilidad de parámetros
  - ✓ Test de Cusum.
  - ✓ Test de Cusum de cuadrados.
  - ✓ Parámetros recursivos.
- 7. Especificación del modelo
  - ✓ Prueba de variables omitidas (razón de verosimilitud, likelihood ratio)
  - ✓ Prueba de variables redundantes (razón de verosimilitud, likelihood ratio).
  - ✓ Prueba de Ramsey-Reset.