

Taller #7
Econometría 06169
Grupo 5

Profesor: Julio César Alonso

Nota: Este taller debe ser entregado en papel y escrito en computador.

Suponga el siguiente sistema de ecuaciones simultáneas:

$$r_t = \beta_0 + \beta_1 M_t + \beta_3 Y_t + \varepsilon_{1,t} \quad (1)$$

$$Y_t = \alpha_0 + \alpha_1 r_t + \alpha I_t + \varepsilon_{2,t} \quad (2)$$

donde, r_t , Y_t , M_t y I_t representan la tasa de interés, Y_t , el PIB, la cantidad de dinero y la inversión doméstica, respectivamente.

1. Responda las siguientes preguntas.
 - a. ¿Cuáles variables son endógenas y exógenas al sistema?
 - b. Explique la intuición económica detrás de este modelo.
2. Continuando con la pregunta anterior:
 - a. Determine cuáles ecuaciones están identificadas o no.
 - b. Estime, empleando la información del archivo D_T7_G5.xls, la (s) ecuación(es) estructural(es) que está(n) identificada(s). Reporte sus resultados en una tabla y explique claramente el método empleado.
3. Continuando con la pregunta anterior:
 - a. Interprete los coeficientes obtenidos en la parte b de la pregunta anterior.
 - b. Discuta la significancia global y conjunta de los coeficientes estimados. Además discuta el "fit" del modelo.
4. Continuando con la pregunta anterior:
 - a. Escriba la forma reducida del sistema. Explique.
 - b. Estime, empleando la información del archivo D_T7_G5.xls, la (s) ecuación(es) reducida (s). Reporte sus resultados en una tabla y explique claramente el método empleado.
5. Continuando con la pregunta anterior:
 - a. Interprete los coeficientes obtenidos en la parte b de la pregunta anterior.
 - b. Discuta la significancia global y conjunta de los coeficientes estimados. Además discuta el "**fit**" del modelo.
6. Explique las implicaciones económicas de los resultados obtenidos en las preguntas anteriores.