

EJERCICIOS

Antoni Espasa

EJERCICIO

- En el modelo $\Delta X_t = 0.5 a_{t-1} + 0.3 a_{t-2} + 0.2 a_{t-3} + a_t$

Calcular los efectos de a_t en observaciones futuras de ΔX_t

Calcular el efecto total que una innovación acaba teniendo en los valores futuros de X_t

Calcular cuanto tiempo tarda en alcanzarse dicho efecto total.

Compárese lo anterior con los correspondientes resultados cuando ΔX_t sigue un proceso estocástico AR(1) en el que el coeficiente autoregresivo toma el valor de 0.5.

EJERCICIO SOBRE SU PROYECTO

- 1.- Estime un modelo con tendencia y estacionalidad deterministas sobre la transformación logarítmica. Interprete los resultados.
- 2.- Estime un modelo como en el caso anterior pero incluyendo, si es el caso, truncamientos tendenciales. Interprete los resultados.
- 3.- Estime un modelo en primeras diferencias, o si la serie tiene estacionalidad en diferencias anuales, con truncamientos tendenciales.

EJERCICIO SOBRE PROTOTIPO DE MODELOS UNIVARIANTES

- Realice el ejercicio distribuido el pasado viernes sobre este tema.