**EXAMEN DE ECONOMETRIA II**

**PARCIAL 2 DEL IIT 2011-2012**

APELLIDOS: .............................................................. NOMBRES: …………………………………….

MATRICULA: ........................ PARALELO: …………..

"Como estudiante de la FEN me comprometo a combatir la mediocridad y actuar con honestidad, por  eso no copio ni dejo copiar".

***Firma de Compromiso del Estudiante***

1. Comente la veracidad o falsedad de las siguientes afirmaciones justificando claramente su respuesta:
	1. **(5pts)** En un modelo de probabilidad bivariado, el hecho de que las iteraciones de la estimación por máxima verosimilitud demoren en converger es síntoma de auto correlación.
	2. **(5pts)** Un panel de datos es balanceado si y solo si existen datos completos para todo i y para todo t.
	3. **(5pts)** En los modelos de elección binaria, la interpretación de los coeficientes es igual tanto en los modelos logit, probit y probabilístico lineal.
	4. **(5pts)** Dos series cointegran si y solo ambas si son I(0).
	5. **(5pts)** Los modelos de datos de panel con efectos fijos siempre son preferibles a los modelos con efectos aleatorios.
	6. **(5pts)** Si una variable es estrictamente exógena, entonces puede ser utilizada para predecir.
2. **(25pts)** Demuestre que un proceso ARCH(1) tiene varianza finita, si $\left|α\right|<1$. Cuáles serían las condiciones para tener varianza finita de un modelo GARCH (1,1)?
3. **(25 puntos)** Considere el siguiente modelo de corrección de errores:

$$∆y\_{t}=α\_{0}+α\_{1}∆y\_{t-1}+γ\_{0}∆x\_{t}+γ\_{1}∆x\_{t-1}+δ\left(y\_{t-1}-βx\_{t-1}\right)+u\_{t}$$

Donde *E(ut|It-1) = 0* y *It-1* contiene información sobre $∆x\_{t}$ y todos los valores pasados de *x* e *y*.

Muestre que si añade otro rezago del término de corrección de error:

 $\left(y\_{t-2}-βx\_{t-2}\right)$, la ecuación sufre de colinealidad perfecta.