

Supuestos de Gretl. 5.1- Viajeros

Ana J. López y Rigoberto Pérez

Dpto. Economía Aplicada, Universidad de Oviedo

Nombre del fichero: **Viajeros.gdt**

Competencias asociadas al Supuesto:

Al finalizar este supuesto los estudiantes deberían ser capaces de:

- ▷ Definir variables dummy estacionales
- ▷ Contrastar restricciones sobre coeficientes
- ▷ Realizar contrastes de especificación sobre un modelo
- ▷ Comparar la bondad de especificaciones alternativas
- ▷ Llevar a cabo los contrastes habituales sobre los residuos del modelo (homocedasticidad, no autocorrelación, normalidad)
- ▷ Estimar modelos autorregresivos
- ▷ Realizar predicciones ex-post y analizar su bondad
- ▷ Compactar un fichero trimestral a anual

Tiempo estimado para el supuesto: 2 hora.

Enunciado:

Se dispone de información trimestral facilitada por el INE para las magnitudes PIB y Remuneración de Asalariados (ambas en miles de euros corrientes, publicadas en la Contabilidad Nacional), el IPC base 2006 (valores acumulados de cada trimestre) y Entradas de viajeros (estimadas por la Encuesta de Ocupación Hotelera).

Con esta base de datos se desea estimar un modelo econométrico para la evolución de los viajeros en el período 1999.1-2007.4 y realizar predicciones para el año 2008.

1. Estimar un modelo que explique la entrada de viajeros hasta finales del año 2007

2. Contrastar la presencia de estacionalidad en las entradas de viajeros
3. Partiendo de un modelo que incluya todas las variables explicativas, llevar a cabo contrastes de especificación interpretando su resultado
4. A la vista de los resultados obtenidos, proponer un modelo y analizar su capacidad explicativa
5. Contrastar las hipótesis habituales sobre los residuos del modelo estimado
6. Llevar a cabo predicciones para las entradas de viajeros en 2008
7. Construir un archivo de trabajo anual, estimando el mismo modelo para los viajeros y comentando las diferencias observadas.