

PRÁCTICA 2

ECONOMETRÍA APLICADA

(ITINERARIO ECONOMÍA MONETARIA Y FINANCIERA)

1. Simular un proceso de ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05 y computar sus funciones de autocorrelación simple y parcial.
2. Simular un proceso Autorregresivo de orden 1 con parámetro $\phi = 0.9$ y constante igual a 2; suponga que el término de perturbaciones es un ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05. Compute sus funciones de autocorrelación simple y parcial. Calcule la función de respuesta a un impulso de una desviación típica.
3. Simular un proceso Autorregresivo de orden 2 con parámetros $\phi_1 = 0.6$ y $\phi_2 = -0.4$ y constante igual a 2; suponga que el término de perturbaciones es un ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05. Compute sus funciones de autocorrelación simple y parcial. Calcule la función de respuesta a un impulso de una desviación típica.
4. Simular un proceso Media Móvil de orden 1 con parámetro $\theta = 0.9$ y constante igual a 2; suponga que el término de perturbaciones es un ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05. Compute sus funciones de autocorrelación simple y parcial. Calcule la función de respuesta a un impulso de una desviación típica.
5. Simular un Paseo Aleatorio con deriva, es decir, con constante igual a 2; suponga que el término de perturbaciones es un ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05. Compute sus funciones de autocorrelación simple y parcial. Calcule la función de respuesta a un impulso de una desviación típica.
6. Simular un proceso ARMA(1,1) con parámetros $\phi = 0.9$ y $\theta = 0.7$ y constante igual a 2; suponga que el término de perturbaciones es un ruido blanco gaussiano con desviación típica igual a 0.05. Compute sus funciones de autocorrelación simple y parcial. Calcule la función de respuesta a un impulso de una desviación típica.