

Programa Extracción de Señales
Maestría en Economía Internacional
Departamento de Economía, Facultad de Ciencias Sociales, UDELAR

Ejercicio domiciliario 1

Fecha de entrega 24/7/2017

Enviar resultados y código con los datos a fborraz@bcu.gub.uy

Los ejercicios domiciliarios se pueden hacer en grupos de hasta 3 alumnos

Busque datos con frecuencia trimestral del PIB en términos constantes y sin desestacionalizar de Argentina, Brasil, y Uruguay (como mínimo debería tener datos del primer trimestre de 1996 al cuarto del 2016).

Se pide:

Ejercicio 1

Descomponga la serie del PIB de cada país en los siguientes componentes: tendencia, estacionalidad, ciclo e irregular. Explique claramente y paso a paso el análisis desarrollado. Discuta si con diferentes métodos o filtros se obtienen similares resultados.

Ejercicio 2

Se desea analizar la relación entre el componente cíclico del PIB de Uruguay y el de Argentina y Brasil. En particular se pide analizar el grado de comovimiento entre dichas series y determinar cuál es la serie líder. Nuevamente, discuta si con diferentes métodos se obtienen similares resultados. Es decir. ¿son diferentes los resultados mediante un análisis de correlaciones de los ciclos?

Ejercicio 3

Para el caso del PIB de Uruguay estime paramétricamente el espectro de la serie con y sin estacionalidad y en niveles y en diferencias. Explique los resultados obtenidos.