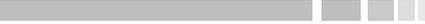


AC 115

Econometría I: manual de Eviews

Estimación de un modelo de exportación

— *María Gabriela Ramos Barrera*



ISSN: 1900-6187

© Primera edición: septiembre de 2016

Oficina de Publicaciones

Sede Chapinero, Cra. 5 # 59A-44

Bogotá, Colombia

PBX: 3 48 8000 exts.: 1224 y 1225

publicaciones@lasalle.edu.co

<http://www.lasalle.edu.co>

Dirección editorial

Guillermo Alberto González Triana

Coordinación editorial

Andrea del Pilar Sierra

Corrección de estilo

Camilo Sierra Sepúlveda

Diagramación

William Yesid Naizaque O.

Carátula

Andrea Julieth Castellanos

Impresión

Xpress Estudio Gráfico y Digital S. A.

AGRADECIMIENTOS

Agradezco a todos aquellos que me apoyaron en este proyecto, en especial a mi familia, por su cariño incondicional, y a mis compañeros Claudia Pico y Óscar Pérez, por motivarme para culminar este trabajo.

María Gabriela Ramos Barrera

CONTENIDO

Agradecimientos	3
Introducción	9
1. Especificación del modelo	11
2. Recolección de datos	13
2.1. Archivos de trabajo en Eviews	13
2.2. Introducción de datos	14
2.3. Guardar objetos y archivos de trabajo	15
2.4. Manejo de los objetos	16
3. Estimación del modelo	17
3.1. Especificación de la línea de regresión	17
3.2. Residuos del modelo estimado	20
3.3. Normalidad de los errores	22
4. Evaluación del modelo	25
4.1. Evaluación estadística	25
4.2. Evaluación econométrica	31
5. Predicción	59
5.1. Estabilidad de los parámetros	59
Conclusiones	65



Bibliografía	67
Anexo	69



ÍNDICE DE FIGURAS

Figura 1. Importación de datos	15
Figura 2. Estimar la ecuación	18
Figura 3. Resultado de la estimación	19
Figura 4. Valores reales, estimados y residuos	20
Figura 5. Valores reales, estimados y residuos	21
Figura 6. Histograma de los residuos	23
Figura 7. Intervalos de confianza	26
Figura 8. Estimación logarítmica	30
Figura 9. Matriz de correlación	33
Figura 10. Determinante de la matriz de variables independientes	33
Figura 11. Regresiones auxiliares del modelo	35
Figura 12. Factor de inflación de la varianza	36
Figura 13. Corrección de la multicolinealidad	38
Figura 14. Prueba gráfica de heterocedasticidad	40
Figura 15. Prueba de Park	41
Figura 16. Prueba de Glejser	42
Figura 17. Prueba de Breusch-Pagan-Godfrey	43
Figura 18. Prueba de White	45
Figura 19. Prueba gráfica de autocorrelación	47
Figura 20. Estadístico de Durbin y Watson	48
Figura 21. Prueba de Markov	49
Figura 22. Prueba de Breusch-Godfrey	51
Figura 23. Corrección de la autocorrelación	52
Figura 24. Prueba de Ramsey	54



Figura 25. Prueba gráfica de los errores	56
Figura 26. Prueba estructural de Chow	60
Figura 27. Prueba de predicción de Chow	61
Figura 28. Capacidad predictiva del modelo	62

