

Econometría II - Trabajo Práctico 1

Cátedra de Econometría II

Profesores Lorena Garegnani y Gabriel Montes-Rojas

Primer cuatrimestre 2021. Universidad Nacional de La Plata

- Explique detalladamente los procedimientos teóricos que sustentan su respuesta. Más importante que los resultados mismos es la justificación de los procedimientos.
- Entregue un documento de Word (o PDF) con las respuestas, las bases de STATA (en .dta) y los do-files (en .do) para que todos los resultados se puedan replicar.
- La fecha de entrega de este trabajo práctico es el **12 de mayo de 2021**.

Modelización y predicción de la inflación en Argentina

Considere la serie de IPC-INDEC (mensual, base diciembre 2016 =100) para la región GBA de diciembre 2016 a marzo 2021 que se puede bajar en:

<https://www.indec.gob.ar/indec/web/Nivel4-Tema-3-5-31>

Calcule las tasas de inflación mensuales (que también están disponibles en esa página web).

1. Evalúe la presencia de tendencia y estacionalidad en la serie de inflación. ¿Cómo construiría una serie desestacionalizada? Grafique la serie original y la desestacionalizada.

2. Seleccione un modelo adecuado para la serie de inflación y estímelo. Comente sobre los parámetros estimados.
3. Arme un pronóstico para la inflación de abril, mayo y junio 2021, usando un modelo estimado con datos de diciembre 2016 a marzo 2021. Evalúe si su modelo elegido en el punto 1 es adecuado comparándolo con los datos observados de abril 2021.
4. Pronostique la inflación anual para todo 2021 usando los datos observados hasta marzo 2021, y pronosticando los meses restantes.