Ejercicios Capítulo XI

- 11.1 A lo largo de este libro, “log” significa logaritmo neperiano (en base e). ¿Cómo diferirían, de hacerlo, los resultados numéricos del ejemplo de la demanda de dinero si hubiésemos tomado logaritmos habituales (en base 10)?
- 11.2 Utilizando los resultados de las regresiones (11.1) y (11.3), derive la pendiente de la “otra regresión corta” en (11.5), esto es, de la regresión de Y sobre X_2 . Pista: desarrolle la regla de la variable omitida con los papeles de X_1 y X_2 cambiados. La pendiente y el R^2 de la regresión auxiliar (11.3) pueden ser utilizadas para determinar la pendiente de la *otra regresión auxiliar*.
- 11.3 ¿Es útil el procedimiento W^0 de contraste de significatividad de un parámetro cuando la hipótesis alternativa es unilateral, por ejemplo $\beta_2 > 0$?
- 11.4 **Demanda de dinero.** Supongamos que ampliamos la definición de dinero desde $M1$ a $M2$ (que incluye además depósitos de ahorro, activos financieros, etc). Recordemos que en el archivo TIM1, la variable $M2$ medida en términos nominales aparece bajo el epígrafe $V8$.
- Rehaga el análisis efectuado en este capítulo utilizando $V8$ en lugar de $V2$ como medida del dinero en términos nominales.
 - Discuta cualquier diferencia significativa entre los resultados obtenidos empleando $M1$ y $M2$.
- 11.5 Cuando la Federal Reserve Board está decidiendo si iniciar o no alguna acción destinada a reducir los tipos de interés, ¿debería tener en cuenta si los tipos de interés son “más significativos” que el PIB en las regresiones sobre la demanda de dinero? Discutir.
- 11.6 Verifique todos los pasos efectuados en la derivación de la ecuación (11.4). Regresión múltiple: Caso general