

PRÁCTICAS 2 Y 3: CONCEPTOS BÁSICOS

- Estimación MCO
- Interpretación coeficientes estimados
- El nivel de significación crítico
- Interpretación de otros estadísticos relevantes
- Contraste sobre un subconjunto de coeficientes

```

=====
Dependent Variable: ALEM
Method: Least Squares
Sample(adjusted): 1987:01 1999:11
Included observations: 155 after adjusting endpoints
=====

```

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-17544.51	19215.43	-0.913043	0.3628
F2	26799.70	24560.00	1.091193	0.2770
F3	102633.6	24560.78	4.178758	0.0001
F4	191316.6	24562.07	7.789106	0.0000
F5	316109.2	24563.88	12.86886	0.0000
F6	261285.1	24566.20	10.63596	0.0000
F7	278410.2	24569.05	11.33175	0.0000
F8	259558.1	24572.40	10.56299	0.0000
F9	313861.2	24576.28	12.77090	0.0000
F10	240968.0	24580.67	9.803152	0.0000
F11	11629.33	24585.57	0.473014	0.6369
F12	-17315.89	25072.51	-0.690632	0.4909
T	1865.221	112.6641	16.55559	0.0000

```

=====
R-squared          0.865722      Mean dependent var 294559.7
Adjusted R-squared 0.854375      S.D. dependent var 164082.5
S.E. of regression 62615.31      Akaike info criteri25.00755
Sum squared resid  5.57E+11      Schwarz criterion  25.26281
Log likelihood      -1925.085      F-statistic         76.29241
Durbin-Watson stat  0.435267      Prob(F-statistic)   0.000000
=====

```

- o Interpretar las variables F2 a F12 ¿Por qué no aparece F1?
- o Interpretar la variable t
- o Interpretar las distintas columnas: especial atención al p-value (Prob)
- o Utilización del p-value para contrastar hipótesis
- o ¿Cómo es la tendencia a largo plazo de la serie?
- o ¿Cuál es términos medios el mejor mes desde el punto de vista del turismo alemán?. Interpretar coeficiente
- o ¿Cuál es en términos medios el peor mes para el turismo alemán? ¿Qué sucede con los meses de enero, febrero, noviembre y diciembre?
- o Interpretación de otros estadísticos relevantes en la ventana de resultados:
 - R cuadrado y R cuadrado ajustado ¿Por qué ajustar el R cuadrado?
 - ¿Qué es el error estándar de la regresión?.
 - Interpretación y expresión del log de la función de verosimilitud

- ¿Cómo construir el estadístico AIC? Comparar con el R cuadrado y el R cuadrado ajustado
 - El contraste de significatividad global del modelo
 - El contraste de autocorrelación de orden 1 y el estadístico de DW
- Contraste sobre un subconjunto de parámetros: ejemplo mediante el contraste de la existencia de estacionalidad:

```
=====
Wald Test:
Equation: Untitled
=====
Null HypothesisC(2)=0
                C(3)=0
                C(4)=0
                C(5)=0
                C(6)=0
                C(7)=0
                C(8)=0
                C(9)=0
                C(10)=0
                C(11)=0
                C(12)=0
=====
F-statistic      56.30908      Probability      0.000000
Chi-square       619.3998      Probability      0.000000
=====
```

- o ¿Qué se está contrastando con esta hipótesis? Interpretar
- o ¿Qué podemos decir sobre la estacionalidad de la serie de turistas alemanes?