

Proyecto Empírico: Efectividad de la política monetaria

Entrega 0

Técnicas Econométricas

Septiembre 2024

1 Guía

1.1 Información Importante

- La Entrega 0 no se evaluará pero es **REQUISITO INDISPENSABLE** para que se consideren para nota las siguientes entregas del proyecto empírico
- El proyecto se realizará en grupos de 3 estudiantes: Uno de ellos tiene que actuar de representante
- La fecha de entrega por Aula Global será el Viernes 20 de Septiembre a las 23:50h. No se admitirán entregas fuera de plazo. **SOLO** el representante tiene que subir la entrega 0 en PDF a Aula Global.

1.2 ¿Qué hay que hacer en la Entrega 0?

- **STEP 1.** Escoger un país (que no sea EEUU) y obtener los siguientes datos en formato Excel:
 - VARIABLE REAL (elegir una)
 - * PIB real per capita (frecuencia trimestral) ajustada estacionalmente
 - * Índice de Producción Industrial (frecuencia mensual) ajustada estacionalmente
 - VARIABLE NOMINAL: Tipos de interés a corto, medio o largo plazo en frecuencia mensual

- * Se requiere que trabajéis con datos de al menos un tipo de interés a un tipo de plazo, esto es, tipo de interés a corto, a medio o largo plazo. Consejo Descargamos varios tipos de interes por si tuvierais que usar el "spread"= diferencia entre el largo y el corto.
- **Se requiere COMO MÍNIMO:**
 - * 200 observaciones si trabajáis en frecuencia trimestral
 - * 300 observaciones si trabajáis en frecuencia mensual
 - * Todas las variables deben llegar como minimo al final del año 2023
 - * Tened en mente que si hay T observaciones, las primeras R se usaran para construir un modelo y las ultimas P ($T=R+P$) para predecir.

de AMBAS variables. Puede que las dos variables con las que vais a trabajar tengan diferente número de observaciones (Ej: PIB 250 obs y tipo de interés l/p 220). Esto no representa un problema: ajustaremos la muestra más tarde con Eviews (si quereis desde el principio elegid las T observaciones comunes)
- Bases de datos recomendadas:
 - * <https://fred.stlouisfed.org/>.
 - Aquí os dejo un vídeo de como descargar datos del FRED: [video](#)
 - * <https://data.oecd.org/>
 - * <https://data.imf.org/>
- **Hablad entre vosotros para que no coincidan los paises a analizar. Si coincidiesen un grupo puede trabajar con el PNB y otro con el IPI. Recomendación: antes de seleccionar el país, aseguraos de que hay suficientes datos disponibles.**
- **STEP 2.** Una vez hemos elegido país y variables, procedemos a crear un workfile en Eviews y a transformar las variables.
 - Para aprender a crear un workfile en Eviews, crear nuevas variables y hacer gráficos ver el siguiente video:
 - * [Crear un workfile](#)
 - * [Transformar variables](#)
 - * [Hacer gráficos](#)
 - **¿Cómo acceder a Eviews desde casa?**
 - * Acceder a un ordenador de la facultad por control remoto. Esto se puede hacer a través de aula virtual usando vuestras credenciales: <https://aulavirtual.uc3m.es/login/>. Hacer click en el cuadro de 'uc3m FCSJ y FHCD'

- * Descargarnos los datos en el escritorio remoto
- * Acceder a Eviews a remoto
- * **ADVERTENCIA: Como vais a usar Eviews a control remoto, no podréis guardar el workfile ni los gráficos que debéis crear para esta entrega directamente en vuestro ordenador.** Para disponer de los gráficos en vuestro escritorio, una opción es realizar capturas de pantalla cuando aparezcan los gráficos y reenviaros tales capturas a vosotros mismos por email. Es muy RECOMENDABLE que os guardéis el workfile proque lo usaremos en prróximas sesiones.

1.3 ¿Qué hay que entregar como Entrega 0?

- Un documento en formato PDF como máximo 3 hojas dónde se esepifique claramente:
 - Nombre y apellidos de los estudiantes. Quien ejercera de representante del grupo.
 - Nombre del país seleccionado
 - Frecuencia de los datos
 - Número de observaciones y muestra temporal (periodo inicial y final)
 - Gráficos de la variable real y nominal transformadas y sin transformar que habéis generado con Eviews:
 - * Gráfico de PIB o IP
 - * Gráfico de $\Delta \ln(PIB)$ o $\Delta \ln(IP)$
 - * Gráfico de tipos de interés (r)
 - * Gráfico de Δr