

TAREA 3.2. Análisis de residuos.

Para trabajar este tema es de interés realizar previamente las siguientes lecturas:

- Capítulo 5 del libro *Econometría* de Alonso, Fernández y Gallastegui (2004).
- Apartado 6.4 del libro *Introductory Econometrics* de Wooldridge(2003)

En esta tarea se va a trabajar dos casos de estudio:

1. Datos de sección cruzada sobre salarios: SALARIO.GDT.
2. Datos de series temporales (trimestrales) sobre demanda de electricidad en San Diego: ELECTRICIDAD1.GDT.

Estos datos están adaptados del fichero `data9-3.gdt` del libro de Ramanathan (2002) que se puede encontrar en:

http://gretl.sourceforge.net/gretl_data.html

Para ambos casos de estudio:

- Estima el modelo de regresión lineal general incluyendo todas las variables explicativas disponibles.
- Comenta los gráficos de los residuos: por observación, contra las variables explicativas, etc.
- ¿Tienen la misma utilidad estos gráficos de residuos para el caso de datos de sección cruzada que para los datos de series temporales?
- ¿Qué conclusiones sobre la bondad de la especificación del modelo puedes obtener de este análisis de residuos?

Esta tarea se va a discutir en grupos pequeños en el seminario 5.