**Econometría II – Curso 2019/2020 – Grupo 237 – Ejercicios #3**

1. Con una muestra de 110 observaciones de la variable  se ha estimado el siguiente modelo , donde  es ruido blanco . Se sabe que la información sobre  y  se ha perdido excepto los valores , , ,  y .
2. Realizar las predicciones de  para los periodos 111, 112 y 113 a partir del último valor observado .
3. Calcular la varianza para las previsiones anteriores.
4. Construir los intervalos de confianza al 95%.
5. Actualizar las predicciones para los periodos 112 y 113 cuando se observa .
6. Se ha estimado el modelo , donde  es ruido blanco , con una muestra de 49 observaciones de la variable . Se conocen los siguientes valores: ,  y .
7. Realizar las predicciones de  para los periodos 50, 51, 52 y 53 a partir del último valor observado .
8. Calcular la varianza para las previsiones anteriores.
9. Construir los intervalos de confianza al 95%.
10. Actualizar las predicciones para los periodos 51, 52 y 53 cuando se observa .