

# ECONOMIA APPLICATA M - LABORATORIO 5d

21/1/20

AGSDATA . DTA

RELAZIONE TRA CONSUMO (C) E  
PUBBLICITÀ (A)

LA, LC, LUC

## DESTABILIZZAZIONE

$$\Delta \Delta_4 = (1-L)(1-L^4) =$$

$$\text{DNE } \Delta \equiv 1-L = 1-L-L^4+L^5$$

## TEST DI G-C

$$\Delta a_t = \alpha + \beta \Delta a_{t-1} + \gamma_1 \Delta c_t + \gamma_2 \Delta c_{t-1} + u_{at}$$

$$H_0: \gamma_1 = \gamma_2 = 0 \quad (\text{NO G-C} \Rightarrow \underline{\underline{C \not\Rightarrow A}})$$

$$\text{vs} \quad H_1 \quad (\text{SI G-C} \Rightarrow \underline{C \Rightarrow A})$$

$\Downarrow$

$$H_0: \text{RIFURATA (AL 5\%)} \Rightarrow \boxed{C \rightarrow A}$$

LA RESSIONE SPOSTIVA (E VISTO F A ESSA  
NEURO) SENSIVE CHE  $\boxed{A \rightarrow C}$

$$\Delta C_t = \alpha + \beta \Delta C_{t-1} + \gamma_1 \Delta R_t + \gamma_2 \Delta R_{t-1} + U_t$$

$$H_0: \gamma_1 = \gamma_2 = 0 \quad (A \rightarrow C) \quad \text{NON RIFURATA AL 5\%}$$

Cross-correlazione (sui residui)

$e_{2t}$ ,  $e_{1t}$

$$\hat{\rho}_k = \text{corr}(e_{2t}, e_{1t-k}), \quad k=0, 1, 2, \dots, T$$

$k > 0$

: SE almeno un valore di  $\hat{\rho}_k$  è significativamente diverso da zero, allora  $C \rightarrow A$

K20

: SE ANCHE UN VALORE DI  $\hat{P}$  FORTE SUFFICIA-  
TAMENTE DIVERSO DA ZERO, ALLORA  $A \rightarrow C$

SUWA GASE OEL CLASS-GOLDBACHEN,

$C \rightarrow A$  E  $A \rightarrow C$

RISULTATO DA INVESTIGAZIONE USANDO ANALISI !!