

UNIVERSIDAD CIENTIFICA DEL SUR
FACULTAD DE CIENCIAS DE INGENIERÍA Y EMPRESA
ESCUELA DE INGENIERIA ECONÓMICA Y DE NEGOCIOS



**Estimación Econométrica De La Función Baumoliana De
Demanda De Dinero En El Perú: Un Análisis De Estabilidad De
Parámetros.**

Por:

Bach. Arturo Giovanni Derteano Bravo

**Trabajo Profesional Para Optar El Título De Ingeniero
Economista.**

2011

INDICE	2
Dedicatoria	3
Resumen ejecutivo	4
Introducción	5
Capítulo Primero	
Planteamiento metodológico del problema	6
1.1 Antecedentes de la problemática y principales hechos estilizados	
1.2 Planteamiento del problema	
1.3 Objetivos de la investigación	
1.4 Justificación	
1.5 Hipótesis de trabajo	
1.6 Fundamentos macroeconómicos de la investigación	
1.7 Evolución histórica de las variables en el periodo de estudio	
1.8 Análisis de correlación de las series involucradas en la estimación	
1.9 Evidencia respecto a Baomol-Tobin y la demanda transaccional por dinero	
Capítulo Segundo	
Aspectos metodológicos	15
2.1 Principales hechos estilizados	
2.2 Metodología	
2.3 Instrumentos	
2.4 Recolección de datos	
2.5 Experimentación del modelo	
2.6 Análisis univariado de las series	
2.6.1 Análisis univariado del logaritmo del circulante	
2.6.2 Análisis univariado para el logaritmo de la inflación	
2.6.3 Análisis univariado para el logaritmo del producto bruto interno real	
2.6.4 Análisis univariado para el logaritmo de la tasa de interés pasiva en moneda nacional	
2.7 Especificaciones econométrica	
2.8 Análisis e interpretación de resultados	
2.9 Errores de especificación del modelo	
Capítulo Tercero	
Evaluación econométrica	38
3.1 Estabilidad del modelo, autocorrelación, heterocedasticidad y multicolinealidad	
3.2 Implementación de variables dummies	
3.3 Análisis de la simulación del modelo	
3.3.1 Simulación histórica	
3.3.2 Evaluación de la bondad predictiva del modelo	
Capítulo Cuarto	
Conclusiones y recomendaciones de política	46
Bibliografía	50
Anexo	51