

# Econometria (2+1+1)

---

## Programa:

### 1. Errors d'especificació i selecció de models.

- 1.1 Omissió de variables rellevants i inclusió de variables supèrflues. Efectes sobre el biaix i sobre l'eficiència dels estimadors.
- 1.2 Criteris de selecció de models: Theil, Akaike, Schwarz.
- 1.3 Test d'especificació defectuosa.
- 1.4 Aplicacions.

### 2. Models dinàmics.

- 2.1 Desfassaments de les variables explicatives.
- 2.2 Desfassaments de la variable endògena: ajustament parcial, adaptació de les expectatives i models del mecanisme de correcció de l'error.
- 2.3 Aplicacions.

### 3. Models d'elecció directa.

- 3.1 Models amb la variable dependent binària.
- 3.2 Models amb la variable dependent censurada. El model Tobit.
- 3.3 Aplicacions.

### 4. Models de series temporals.

- 4.1 La descomposició d'una sèrie temporal en les seves components. El filtre de Hodick-Prescot.
- 4.2 Models univariants de series temporals
- 4.3 Aplicacions.

## Pràctiques:

Es fan pràctiques dels mètodes desenvolupats a la teoria amb el paquet ECONOMETRIC VIEWS

## Bibliografia bàsica:

- E. R. Bernd (1991): "The practice of econometrics". Addison-Wesley.
- J. JOHNSTON (1987): "Métodos de econometría". Vicens-Vives.
- G. S. MADDALA (1996): "Introducción a la econometría". Prentice Hall.