



Universitat Autònoma de Barcelona

TITULACIÓ: Estadística

NOM DE L'ASSIGNATURA: 27984 Econometria

CURS: 2002/2003

CRÈDITS: 6

PROGRAMA DE TEORIA:

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:

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.