



El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión (No. 199) de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que, con el título

A simple test for Spurious Regression

impartirá

**Daniel Ventosa Santaulária
Departamento de Economía
Universidad de Guanajuato**

Resumen

We propose a statistical procedure to detect spurious regression. Once the variables have undergone a battery of unit-root tests and there is substantial evidence of a trending mechanism, our procedure filters them through a deterministic auxiliary regression. The filtered variables are then employed as substitutes in the original specification. This filtering eliminates – asymptotically - the nuisance parameters in the distribution of the-rescaled-t-ratio associated to the regressand. Finite-sample evidence supports our asymptotical findings.

Fecha: Viernes 21 de Agosto

Hora: 13:00 hrs.

Salón: B-2

Lista de seminarios próximos. Visite:

<http://estadistica.itam.mx/seminarios.html>

El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes, por lo que el Departamento de Estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.

María F. Rojano Agraz
ITAM
Depto. Académico de Estadística
Río Hondo # 1,
Col. Tizapán San Angel
C.P. 01000 México, D. F.
Tel. 5628-4000 ext. 3803
Fax 5628-4086