

	ENSENYAMENT D'ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESES CURS ACADÈMIC 2003 - 2004		
	ASSIGNATURA: ECONOMETRIA II		
	PROFESSOR/A: JOAN BARÓ LLINÀS		
	CURS: 2n	CRÈDITS: 4,5	TIPUS: TRONCAL

1. OBJECTIUS

Progressar en l'estudi de l'anàlisi economètrica des del coneixement assolit a Econometria I (assignatura que esdevé necessària per comprendre Econometria II). Especificar models econòmics més complexos (dinàmics o multiequacionals), estimar llurs relacions i contrastar els resultats.
Distingir entre diferents tècniques d'anàlisi multivariant, saber-les aplicar amb suport informàtic i interpretar els resultats.

2. CONTINGUTS

Models dinàmics
Models de relacions simultànies
Anàlisi Multivariant

3. PROGRAMA

1. Especificació del model de relacions simultànies
 - 1.1. Introducció
 - 1.2. Formes estructural i reduïda
 - 1.3. Tipus de models estructurals
2. Identificació
 - 2.1. Introducció
 - 2.2. Condicions d'ordre i rang
 - 2.3. Identificació amb restriccions en els paràmetres
 - 2.4. Identificació amb altres restriccions
3. Dinàmica i simulació en models multiequacionals
 - 3.1. Models uniequacionals amb retards distribuïts
 - 3.2. Sistema d'equacions finals en models multiequacionals
 - 3.3. Multiplicadors
 - 3.4. Condicions d'estabilitat

4. Estimació
 - 4.1. Introducció
 - 4.2. Mínims quadrats directes
 - 4.3. Mínims quadrats indirectes
 - 4.4. Mínims quadrats bietàpics
 - 4.5. Variables instrumentals
 - 4.6. Màxima versemblança amb informació limitada
 - 4.7. Estimadors de la classe K
 - 4.8. Mínims quadrats trietàpics
 - 4.9. Màxima versemblança amb informació completa
 - 4.10. Interval·ls de confiança simultanis
5. Anàlisi Multivariant
 - 5.1. Anàlisi de Components Principals
 - 5.2. Anàlisi de Correlacions
 - 5.3. Anàlisi Cluster
 - 5.4. Anàlisi Discriminat
 - 5.5. Altres tècniques d'anàlisi
6. Aplicacions econòmriques
 - 6.1. Metodologia del treball empíric
 - 6.2. Discussió d' estudis econòmrics

4. MATERIALS DE L'ASSIGNATURA

Apunts en format electrònic.
 Exercicis en la Web de l'assignatura
 Programa MINITAB
 Bibliografia

5. BIBLIOGRAFIA

Aznar, A. i altres (1994)
 "Ejercicios de Econometría I"
 "Ejercicios de Econometría II"
 Ediciones Pirámide. Madrid

Gujarati, D.N (1997)
 "Econometría"
 McGraw Hill. Madrid

Levy, J.P i altres (2003)
 "Análisi Multivariable para las Ciencias Sociales"
 Pearson. Prentice Hall. Madrid (2003)

Maddala, G.S. (1985)
 "Econometría"
 McGraw-Hill. Mèxic

Novalés, A. (1995)
 "Econometría"
 McGraw-Hill. Madrid

6. AVALUACIÓ

Examen