

CURS ACADÈMIC: 2004 – 2005
ENSENYAMENT: ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESES

ASSIGNATURA: ECONOMETRIA II

PROFESSOR: JOAN BARÓ LLINÀS

CURS: SEGON

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 economètrics 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 Cluster
 - 5.3. Altres tècniques d'anàlisi
- 6. Aplicacions economètriques
 - 6.1. Metodologia del treball empíric
 - 6.2. Discussió d'estudis economètrics

4. MATERIALS DE L'ASSIGNATURA

Bibliografia

Apunts en suport electrònic.

Programes informàtics

Macros d'aplicació informàtica

Lliurament d'exercicis en suport paper

5. BIBLIOGRAFIA

Aznar, A. i altres (1994)

"Ejercicios de Econometría I"

"Ejercicios de Econometría II"

Ediciones Pirámide. Madrid

Maddala, G.S. (1985)

"Econometría"

McGraw-Hill. Mèxic

Novales, A. (1995)

"Econometría"

McGraw-Hill. Madrid

Wallis, K (1980)

Econometría aplicada.

De. Saltés. Madrid

6. AVALUACIÓ

Examen presencial