



UNIVERSITAT DE LLEIDA
FACULTAT DE DRET I ECONOMIA

CURS ACADÈMIC 2007 - 2008

TITULACIÓ: LLICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESES

PLA D'ESTUDIS: 1995

ASSIGNATURA: ECONOMETRIA II (Codi 3518)

PROFESSOR: JOAN BARÓ LLINÀS

CURS: 2n
QUADRIMESTRE: 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 o METODOLOGIA

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. Intervalls 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 econòmics

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, L. (1980), "*Econometría aplicada*", De. Saltès. Madrid

6. AVALUACIÓ

Examen presencial