



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

#### **6. AVALUACIÓ**

Examen presencial