



TITULACIÓ: LLICENCIATURA EN ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESSES

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
- 1.4 La identificació dels models
- 1.5 Condicions d'ordre i de rang
- 1.6 Exercicis resolts
- 1.7 Activitas

2. Dinàmica i simulació en models multiequacionals

- 2.1 Models uniequacionals amb retards distribuïts
- 2.2 Sistema d'equacions finals en modeles multiequacionals
- 2.3 Multiplicadors
- 2.4 Exercicis resolts
- 2.5 Activitas

3. ESTIMACIÓ

- 3.1 Mínims quadrats directes
- 3.2 Mínims quadrats indirectes
- 3.3 Mínims quadrats bietàpics
- 3.4 Variables instrumentals
- 3.5 Altres mètodes d'estimació
- 3.4 Exercicis resolts
- 3.5 Activitas

4. ANÀLISI DE COMPONENTS PRINCIPALS

- 4.1 Introducció
- 4.2 Matriu de dades i objectius
- 4.3 Procediment per a l'obtenció dels components principals
- 4.4 Interpretació dels resultats
- 4.5 Exercicis resolts
- 4.6 Activitats

5. ANÀLISI CLUSTER

- 5.1 Introducció
- 5.2 Mesures de dissimilitud
- 5.3 Algorisme de classificació
- 5.4 Presentació dels resultats
- 5.5 Altres consideracions.
- 5.6 Exercicis resolts
- 5.7 Activitats

6. ANÀLISI DE CORRESPONDÈNCIES

- 6.1 Introducció
- 6.2 Disseny de l'anàlisi de correspondències
- 6.3 Obtenció dels eixos factorials
- 6.4 Interpretació de resultats
- 6.6 Exercicis resolts
- 6.7 Activitats

7. ANÀLISI DISCRIMINANT

- 7.1 Introducció
- 7.2 Taula inicial de dades
- 7.3 matrius de variacions
- 7.4 Càlcul de l'eix discriminador òptim
- 7.5 Procediment per al càlcul dels eixos
- 7.6 Paquet estadístic MINITAB
- 7.7 Exercicis resolts
- 7.8 Activitats

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

Avaluació continuada