



**UNIVERSITAT DE LLEIDA
FACULTAT DE DRET I ECONOMIA**

CURS ACADÈMIC 2005 - 2006

ENSENYAMENT: ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESES

ASSIGNATURA: ECONOMETRIA II

PROFESSOR/A: JOAN BARÀ 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

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
 - 3.2 Multiplicadors
 - 3.3 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 Intervals 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

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

- Wallis, K (1980)
 - Econometría aplicada.De. Saltés. Madrid

6. AVALUACIÓ

Examen presencial