



UNIVERSITAT
ROVIRA I VIRGILI

FACULTAT DE CIÈNCIES
ECONÒMIQUES I EMPRESARIALS

Llicenciatura en Administració i Direcció
d'Empreses
Pla d'estudis de 1992

16012021
Econometria II
(4,5 crèdits)

Llicenciatura en Administració i Direcció d'Empreses

Pla estudis 1992

Codi Assignatura: 16012021

Nom Assignatura: Econometria II

Crèdits: 4.5

Objectius de l'assignatura i criteris d'avaluació

Examen al finalitzar el cuatrimestre. Ejercicios numéricos y desarrollo de supuestos prácticos utilizando software apropiado.

Tema 1 . INTRODUCCIÓN AL ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES

1.1 Procesos estocásticos estacionarios

1.2 Función de autocorrelación y correlograma

1.3 Modelos lineales en procesos estocásticos estacionarios: Modelos autorregresivos (AR), medias móviles (MA) y mixtos (ARMA)

1.4 Raíces unitarias, cointegración y modelos de corrección del error

Tema 2 . MODELOS DINÁMICOS UNIECUACIONALES

2.1 Diversas formulaciones dinámicas

2.2 Modelos con retardos distribuidos

2.3 Formulaciones alternativas: Expectativas adaptables y Koyck

2.4 Estimación de modelos con retardos finitos: h de Durbin y variables instrumentales

2.5 Estimación de modelos autorregresivos

Tema 3 . MODELOS DE ECUACIONES SIMULTÁNEAS

3.1 Naturaleza y justificación de los modelos multiecuacionales

3.2 Forma estructural y forma reducida

3.3 El problema de la identificación

3.4 Métodos de estimación de los modelos de ecuaciones simultáneas: información limitada y completa

Bibliografia Bàsica

- - **GUJARATI, D.N.:** *Econometria*, Ed. McGraw-Hill, Mexico, 1997.
- - **JOHNSTON, J. and DiNARDO, J.:** *Econometric Methods*, Ed. McGraw-Hill, 1997.
- - **KENNEDY, P.:** *A Guide to Econometrics*, MIT Press, 1992.
- - **NOVALES, A.:** *Econometría*, Ed. McGraw-Hill, Madrid, 1993.

Bibliografia Complementària

- - **BALTAGI, B.H.:** *Econometrics*, Ed. Springer-Verlag, 1999.
- - **GREENE, W.H.:** *Análisis Económico*, Ed. Prentice Hall, 1999.
