

MODELOS ECONOMÉTRICOS DE PREDICCIÓN Y ANÁLISIS **CUANTITATIVO**

Prof.: J. Ll. Raymond

Programa

- * Análisis de series temporales. La metodología Box-Jenkins
- * Modelos dinámicos. Función de transferencia y ecuaciones estocásticas en diferencias
- * Raíces unitarias y cointegración
- * Modelos VAR. Cointegración en modelos VAR
- * Modelos de elección discreta

Bibliografía

- * Box, G.E.P. y Jenkins, G.M. "Time series analysis, forecasting and control", Holden-Day, 1976
- * Davidson, R. y MacKinnon, J.G. "Estimation and inference in econometrics", Oxford University Press, 1993
- * Granger, C.W.J. y Newbold, P. "Forecasting economic time series", Academic Press, 1986
- * Greene, W. H. "Econometric analysis", Macmillan Publishing Company, 1993
- * Harvey, A. "The econometric analysis of time series", Philip Allan, 1990
- * Lutkepohl, H. "Introduction to multiple time series analysis", Springer-Verlag, 1993
- * Uriel, E. "Análisis de series temporales. Modelos ARIMA", Paraninfo, 1985

Programa informático

Econometric Views para windows, Q.M.S. Quantitative Micro Software, Irvine, California, 1995

MODELS MATEMÀTICS DE L'ECONOMIA II, 1996-97

Professor: Ferran Sancho

OBJECTIUS

El curs explora, ben a fons, les propietats dels models lineals d'interdependència econòmica. L'objectiu és familiaritzar a l'estudiant tant amb la teoria bàsica dels models lineals com amb les tècniques concretes i els mètodes d'anàlisi empírica que s'en deriven per a l'anàlisi d'alguns problemes específics com la incidència de la política impositiva, els efectes dels ajustos salarials, o l'anàlisi medi-ambiental.

TEMES

1. Teoria bàsica dels models lineals (2 setmanes)

Repàs d'àlgebra lineal. Àlgebra de matrius no-negatives. Valors i vectors propis de matrius no-negatives

2. El model econòmic bàsic. (3 setmanes)

Construcció del model. Supòsits, versions i propietats del model.

3. Aplicacions teòriques. (1 setmana)

El model econòmic de Marx. Teoria del valor treball. Explotació i taxa de guany

4. La versió empírica del model lineal bàsic. (1 setmana)

Com construir el model a partir de les dades empíricament observades. Calibració. Comparació amb el model teòric.

5. Incidència dels impostos sobre les transaccions econòmiques. (2-3 setmanes)

Com analitzar l'efecte-cost dels impostos indirectes i l'efecte-cost de la indexació salarial.

6. Efectes de la productivitat i el creixement sobre la ocupació. (1 setmana)

Com es pot distingir en els canvis en el nivell d'ocupació aquells que són deguts a l'efecte negatiu dels increments de productivitat dels deguts a l'efecte positiu del creixement econòmic.

7. Activitats productores de externalitats medi-ambientals i mètodes de control. (1-2 setmanes)

Com estudiar els efectes sobre l'activitat econòmica induïts per la presència d'activitats que generen externalitats medi ambientals.

8. Extensions del model lineal bàsic. (1 setmana)

MATERIAL DE TREBALL

El llibre "Economía Política y Modelos Multisectoriales" de J. M^a Vegara, ed. Tecnos, cobreix parcialment la matèria del curs. Es facilitaran notes i lectures fotocopiades que ajudaran a cobrir la resta de continguts. També es repartiran regularment llistes de problemes i exercicis. Es responsabilitat de l'estudiant el treballar-los individual o col·lectivament.

EXÀMENS

Hi haurà un examen de tota la matèria al final del semestre. A més, és possible que es faci un test a finals de Novembre durant l'hora de classe o per casa. Aquest test, si es fa, s'anunciarà amb una setmana d'anticipació i només comptarà parcialment per la nota del curs (entre un 15 i un 20 percent).