



Departament d'Economia de l'Empresa

Universitat Autònoma de Barcelona
Edifici B- Campus de la UAB - 08193 Bellaterra (Cerdanyola del Vallès) - Barcelona. Spain
Tel.: 34 93 581 12 09 - Fax: 34 93 581 2555
d.econ.empresa@uab.es - www.uab.es/dep-economia-empresa/

PROGRAMA D'INVESTIGACIÓ OPERATIVA II (MÈTODES DE PREVISIÓ)

Curs	Cicle	Codi assignatura	Quadrimestre	Crèdits
2003-2004	2on	25085	febrer-maig	4.5

Grup	Professor
51	David Pujolar

DESCRIPTOR DE L'ASSIGNATURA:

El curs pretén familiaritzar els alumnes amb els principis metodològics bàsics de la modelització i previsió seguint un enfocament rigorós, i alhora pràctic, assistit per ordinador.

MÈTODES DE PREVISIÓ:

1. Mètodes previsionals a l'economia
2. Anàlisi de sèries temporals: fonaments teòrics
3. Models estocàstics lineals univariants de caràcter estacionari: processos ARMA. Aplicacions pràctiques
4. Models estocàstics lineals univariants no estacionaris: processos ARIMA. Aplicacions pràctiques.
5. Models estocàstics no lineals univariants: processos ARCH, GARCH, EGARCH i TARCH. Aplicacions pràctiques
6. Models estocàstics lineals multivariants: introducció als models VAR i VECM. Aplicacions pràctiques

BIBLIOGRAFIA

- Brockwell, P.J. i Davis, R. A. (2002): Introduction to Time Series and Forecasting, 2ª ed. Springer Verlag.
- Diebold, F. (2004): Elements of Forecasting, 3ª ed. South-Western College Publishing (hi ha traducció de la 1ª ed. sota el títol Elementos de Pronósticos a Thomson Learning Paraninfo).
- Hamilton, D. (1994): Time Series Analysis, Princeton University Press.
- Lütkepohl, H. (1993): Introduction to Multiple Time Series Analysis, 2ª ed. Springer Verlag.
- Uriel, E. i Peiró, A. (2000): Introducción al Análisis de Series Temporales, AC.

HORARI:

Dimecres de febrer a maig de 16.30h a 17.45h i de 17.55h a 19.10h

AVALUACIÓ:

Al final del quadrimestre, es realitzarà una prova de coneixements. Durant el curs s'utilitzarà el programa Eviews.

MATERIALS COMPLEMENTARIS:

Planes web del professor a les adreces <http://dpujolar.eresmas.net> i <http://selene.uab.es/dpujolar> ("mirròr" de l'anterior).

TUTORIES:

David Pujolar	Dilluns de 13.10 a 14.10 i de 17.25 a 17.55; dimecres de 19.10 a 20.40; despatx B1.134, telèfon 935813256.
---------------	--