



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
2001-2002	2on	25050	febrer-maig	4.5

Grup	Professor
51	D. Pujolar

DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA:

Introducció als mètodes previsionals dins l'àmbit de l'administració d'empreses: tècniques per a la realització de previsions i simulacions assistides per ordinador.

MÈTODES DE PREVISIÓ: UNA INTRODUCCIÓ

1. Mètodes previsionals a l'economia.
2. Anàlisi de sèries temporals: fonaments.
3. Models estocàstics lineals univariants de caràcter estacionari.
4. Models estocàstics lineals univariants no estacionaris.
5. Models estocàstics no lineals univariants: Models ARCH y GARCH.
6. Models estocàstics lineals multivariants: un esbós.

BIBLIOGRAFIA

- Diebold, F. (2001): Elements of Forecasting, 2^a ed. South-Western College Publishing (hi ha traducció de la 1^a ed. sota el títol Elementos de pronósticos a Thomson Learning Paraninfo).
- Mills, T. (1999): The Econometric Modelling of Financial Time Series, 2^a ed. Cambridge University Press.
- Gouriéroux, C. i Monfort, A. (1997): Time Series and Dynamic Models, Cambridge University Press.
- Hamilton, D. (1994): Time Series Analysis, Princeton University Press.
- Uriel, E. i Peiró, A. (2000): Introducción al análisis de series temporales, AC.

EXÀMENS

Al final del quadrimestre, es realitzarà un examen final. Durant el curs s'utilitzarà el programa Eviews 3.1 (revisió 31).

COMPLEMENTS DOCENTS:

<http://selene.uab.es/dpujolar>

TUTORIES:

D. Pujolar	Dilluns de 13.10 a 13.55; dimecres de 19.10 a 20.25, divendres de 11.45 a 12.45; despatx B1.134, telèfon 935813256.
------------	---