



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 PER A SÈRIES TEMPORALS)

Curs	Cicle	Codi assignatura	Quadrimestre	Crèdits
2002-2003	2on	25085	febrer-maig	4.5

Grup	Professor
51	David Pujolar

DESCRIPTOR DE L'ASSIGNATURA:

El curs pretén familiaritzar els alumnes d'Administració i Direcció d'Empreses 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 i GARCH. Aplicacions pràctiques.
6. Models estocàstics lineals multivariants: introducció als models VAR i VECM. Aplicacions pràctiques.

BIBLIOGRAFIA

- Diebold, F. (2001): Elements of Forecasting, 2ª ed. South-Western College Publishing (hi ha traducció de la 1ª ed. sota el títol Elementos de Pronósticos a Thomson Learning Paraninfo).
- Mills, T. (1999): The Econometric Modelling of Financial Time Series, 2ª 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.

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> ("mirror" 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.
---------------	--