



Universitat de Girona
Facultat de Ciències Econòmiques i Empresariales

Llicenciatura d'Economia
Curs 2000-2001

Assignatura optativa
6 crèdits

Departament d'Economia
Campus de Montilivi
17071 Girona
Fax 34 (9) 72 418032
c.e. msaez@gnomics.udg.es

PROGRAMA DE MODELS ECONOMÈTRICS DE PREVISIÓ

Professor/a: Marc Saez

Objectius:

Es pretenen mostrar des de les més simples tècniques de previsió fins les més professionalitzades, tant pel tractament de dades quantitatives com d'informació subjectiva. Es preten que l'alumne trobi les bases per a l'aplicació d'ajustaments, desestacionalització, enquestes, Delfos, allisats, models ARIMA, models econòmics i altres enfocaments.

Programa teòric:

1.- Introducció: concepte, contingut i estratègia de la predicció.

- 1.1.- Fundamentació científica de la previsió: antecedents històrics.
- 1.2.- Tècniques de previsió alternatives.
- 1.3.- La informació necessària per a la previsió.
- 1.4.- Avaluació de les previsions.
- 1.5.- Alguns programes informàtics per a la previsió.

2.- Tècniques elementals.

- 2.1.- Tècniques gràfiques.
- 2.2.- Mitjanes mòbils.
- 2.3.- Allisats exponencials.
- 2.4.- Anàlisi de la tendència.
 - *Previsió de les vendes al detall (P).*
- 2.5.- Anàlisi de l'estacionalitat.
 - *Previsió inicial de la construcció d'habitatges (P).*
- 2.6.- Anàlisi del cicle.
 - *Dinàmica de l'ocupació a Catalunya.*

3.-Previsió amb models ARIMA.

- 3.1.- Previsió òptima puntual i per interval.
- 3.2.- Diferents horitzonts de predicció.
- 3.3.- Previsió actualitzada.
 - *Previsió de la taxa de canvi euro-dòlar (P).*
- 3.4.- Anàlisi d'intervenció.
 - *Efectes del 'medicamentazo' sobre el consum de fàrmacs a Catalunya (P).*

4.- Previsió amb models de regressió.

- 4.1.- Models de previsió condicional i anàlisi d'escenaris.
- 4.2.- Models de previsió incondicional.
- 4.3.- Previsió amb models dinàmics.
 - *Inici i acabament de la construcció d'habitatges (P).*
- 4.4.- Causalitat.

5.- Previsió amb informació subjectiva.

- 5.1.- Tècniques qualitatives: enquestes d'intencions o expectatives; enquestes d'actituds o sentiments; panells d'experts; mètode Delfos.
- 5.2.- Previsió Bayesiana.
- 5.3.- *Aplicacions de previsions amb informació subjectiva (P).*

Programa de pràctiques:

2.- Tècniques elementals.

- 2.4.- Anàlisi de la tendència.
 - *Previsió de les vendes al detall (P).*
- 2.5.- Anàlisi de l'estacionalitat.
 - *Previsió inicial de la construcció d'habitatges (P).*
- 2.6.- Anàlisi del cicle.
 - *Dinàmica de l'ocupació a Catalunya.*

3.-Previsió amb models ARIMA.

- *Previsió de la taxa de canvi euro-dòlar (P).*
- 3.4.- Anàlisi d'intervenció.
 - *Efectes del 'medicamentazo' sobre el consum de fàrmacs a Catalunya (P).*

4.- Previsió amb models de regressió.

- *Inici i acabament de la construcció d'habitatges (P).*

5.- Previsió amb informació subjectiva.

- 5.3.- *Aplicacions de previsions amb informació subjectiva (P).*

Les classes pràctiques (P) es realitzaran a les aules d'informàtica.

Desenvolupament del programa al llarg del curs:

Segon quadrimestre 14 setmanes

- Lliçó 1 2 setmanes
- Lliçó 2 4 setmanes
- Lliçó 3 3 setmanes
- Lliçó 4 3 setmanes
- Lliçó 5 2 setmanes

Sistema d'avaluació:

Per tal de superar l'assignatura s'ha d'aprovar l'examen final de la convocatòria de juny. A més, els alumnes hauran de realitzar un treball pràctic sobre la matèria impartida durant el curs. Aquest treball representarà com a màxim del 20% de la nota final del curs, sempre i quan s'hagi superat l'assignatura.

Bibliografia bàsica:

Diebold,F. (1999): *Elementos de Pronósticos*. México DF: ITP.

Pulido,A. (1989): *Predicción Económica y Empresarial*. Madrid: Pirámide.

Bibliografia complementària:

Makridakis,S. y Whellwright,S.C. (1989): *Manual de Técnica de Pronósticos*. México DF: Limusa.

Murillo,C. (1994): *Métodos Estadísticos de Series Temporales. Aplicaciones Sanitarias*. Barcelona: SG Editores.

Otero,J.M. (1993): *Econometría. Series Temporales y Predicción*. Madrid: AC.

Saez,M. i Barceló,M.A. (1998): *Econometría. Introducción y Casos Prácticos*. Madrid: Centro de Estudios Ramón Areces.