

Assignatura-Codi

Models econòmètrics de predicció i anàlisi quantitativa	22335
--	--------------

Curs acadèmic	Cicle	Quadrimestre
1997/98	1	octubre-febrer

Grup/s	Professors	Despatx	Telèfon Despatx
01	Josep Ll. Raymond	B3-144	581-1711

PROGRAMA

DESCRIPTOR OFICIAL DE L'ASSIGNATURA

Mètodes de predicció, models de sèries temporals, sèries integrades i cointegrades.

TEMARI DETALLAT DELS CONTIGUTS

- * Anàlisis 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

CALENDARI APROXIMAT

BIBLIOGRAFIA

- * 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

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

HORES TUTORIES

PROFESSOR	HORARI TUTORIES
Josep Ll. Raymond	Dimarts 12:00 - 13:30