

MODELOS ECONOMÉTRICOS DE PREDICCIÓN

Prof. J. I. Raymond

Curso: 1999-2000

Programa

Análisis de series temporales. La metodología Box-Jenkins

Raíces unitarias y cointegración.

Modelos dinámicos

Modelos VAR

Biografía

Box, G.E.P.E. y Jenkins, G.M., (1976), Time series analysis, forecasting and control, Hoden-Day

Lutkephol, H.(1993), Introduction to multiple time series analysis, Springer-Verlag

Uriel, E. (1985), Análisis de series temporales. Modelos ARIMA, Paraninfo

Programa informático

Econometric Views