

Programa de Econometría II.

1. Modelos dinámicos.

- 2.1 Introducción.
- 2.2 Modelos de retardos infinitos: El modelo de Koyck.
- 2.3 Modelos de retardos finitos: El modelo de Almon.
- 2.4 Estimación.

2. Modelos de ecuaciones simultáneas.

Introducción.

- 2.1 Concepto de modelo de ecuaciones simultáneas.
- 2.2 Formas estructural y reducida.
- 2.3 Problemas planteados por los modelos simultáneos.

Identificación y estimación.

- 2.4 Concepto de identificación y condiciones para la misma.
- 2.5 El método de las variables instrumentales.
- 2.6 Otros métodos de estimación.

3. Modelos de elección discreta.

- 3.1 Modelos de elección binaria.
- 3.2 Estimación e Inferencia en los modelos de elección binaria.
- 3.3 Modelos Logit y modelos Probit bivariantes.

Bibliografía

Johnston, J. (1987): Métodos de econometría. 3ª edición. Vicens Vives.

Gujarati, D.N. (1997): Econometría. 3ª edición. McGraw-Hill.

Aznar A. y García Ferrer, A. (1990): Problemas de econometría. 3ª ed. Ed. Pirámide.

Kmenta, J. (1980): Elementos de econometría. 2ª ed. Ed. Vicens Vives

Pindyck R. y Rubinfeld D. (1980): Modelos econométricos. Ed. Labor.

Raymond, J.L. y Uriel, E. (1987): Investigación econométrica aplicada: un caso de estudio. Ed. AC.