

PROGRAMA ANALITICO

ECONOMETRIA II

1.- Modelos con variables dependientes discretas y limitadas. Sesgos de Selección Maddala, G (1983)
Limited Dependent and Qualative Variables in Econometrics, Cambridge Univerty Press.

2.- Estimación con datos de panel y longitudinales.

Hsiao, Cheng, *Analysis of Panel Data*, Cambridge University Press, 1986.

Nerlove, Marc. *Essay on the History of Panel Econometrics*,

<http://www.arec.umd.edu/mnerlove/p-mnerlove.htm>.

Baltagi, Badi, (1995) *Econometric Analysis of Panel Data*, Wiley Press

3.- Métodos Univariados de series de Tiempo: Tests de integración y cointegración.

Método de Corrección de errores. Predicciones.

Enders Walter, (1995) *Applied Econometric Time Series*, Iowa State University, Wiley and Sons, Inc.

Maddala, G. And Kim In-Moo (1995) *Unit Roots, Cointegration, and Structural Change*, Cambridge University Press.

Banerjee, et al (1993) *Co-Integration, Error-Correction, and the Econometric Analysis of Non-Stationary Data*, Oxford University Press.

Hamilton, James (1994) *Time Series Analysis*, Princeton University Press.

4.- Método de Ecuaciones Múltiples, Vectores Autorregresivos (VAR). Regresiones aparentemente no relacionadas (SUR).

Hamilton, James (1994) *Time Series Analysis*, Princeton University Press.

5.- Método de Montecarlo, Calibración de Modelos.

Pesaran Mand Wickens M, (1999) *Handbook of Applied Econometrics*, Blackwell Publishers.

6.- Autocorrelación Espacial

Anselic Luc, (1990) *Some Robust Approaches to testing and estimation in Spatial Econometrics*, *Regional Science and Urban Economecs*, 20.

Hordijk, L. *Spatial Correlation in the Disturbances of a linear Interreional Model*, (1974) *Regional and Urban Economics*, 4.-