

UNIVERSIDADE FEDERAL DO CEARÁ
DEPTO. DE ECONOMIA APLICADA
DISCIPLINA: ECONOMETRIA II
PERÍODO: 2009-I
PROF. IVAN CASTELAR



Avaliação: O desempenho do aluno será medido por duas provas escritas (60%) e um trabalho de curso (40%) envolvendo uma pesquisa empírica que preferencialmente verse sobre o seu tema de monografia.

I. O Modelo Linear Geral Revisitado

1. Propriedades dos estimadores em pequenas amostras.
2. Uma abordagem unificada para testes de hipóteses e estimação sob restrições lineares
3. Noções de teoria assintótica e propriedades dos estimadores em grandes amostras
4. Estimação de máxima verossimilhança
5. Os teste de Lagrange, Wald e da razão de máxima verossimilhança
6. Noções de simulação: Monte Carlo e Bootstrap.
7. GMM e variáveis instrumentais.

II. Modelos Não-Lineares

1. Linearização e os principais algoritmos para modelos não-lineares
2. Inferência em grandes amostras
3. A transformação de Box-Cox e a função de produção de Christen-Ravenkar
4. Testes para modelos não-entrelaçados

III. Dados em Paineis e SUR

1. Estruturas alternativas da matriz de Covariância
2. Efeitos fixos e o estimador de LSDV
3. Efeitos aleatórios e GLS
4. Os testes de Hausman e Breusch-Pagan
5. Painéis Dinâmicos

IV. Equações Simultâneas

1. O problema da identificação em equações simultâneas
2. Estimação por métodos uniequacionais: dois estágios, variáveis instrumentais e verossimilhança limitada
3. estimação por métodos sistêmicos: três estágios e máxima verossimilhança completa

V. Modelos de Escolha Discreta

1. Modelos de Contagem e Regressão de Poisson.
2. Modelos Probit e Logit
3. Censura e truncagem
4. Modelos de Duração

BIBLIOGRAFIA

Livros que devem ser consultados:

Gujarati, D. Econometria Básica. Editora Campus. 2006.

Jonhston, J. Econometric Methods. McGraw-Hill. 1989.
Kmenta, J. Elementos de Econometria. Editora Atlas. 1994.
Maddala, G. S. Econometrics. McGraw-Hill. 1977.
Soares, I. e Castelar, I. Econometria Aplicada com o Uso do E-Views. Livro Técnico. 2003.

Livros de pós-graduação que são recomendáveis:

Greene, W. Econometric Analysis. Prentice Hall. 2003.
Hayashi, F. Econometrics. Princeton U. Press. 2000.
Hamilton, J. D. Time Series Analysis. Princeton University Press. 1994.
Mills,

Livros clássicos que podem ser consultados:


Amemya, T. Advanced Econometrics. Harvard U. Press. 1985.
Dhrymes, P. Econometrics: Statistical Foundations and Applications. Harper & Row. 1970.
Fisk, P. Stochastic Dependent Equations. Charles Griffin & Co. 1967.
Goldberg, A. S. Econometric Theory. John Wiley. 1964.
Graybill, F. An Introduction to Linear Statistical Models. Vol. I. McGraw Hill. 1971.
Judge, G. et alii. The Theory and Practice of Econometrics. John Wiley. 1985.
Maddala, G. S. Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics. Cambridge U. Press. 1983.
Rao, C. R. Linear Statistical Inference and its Applications. John Wiley. 1965.
Theil, H. Principles of Econometrics. John Wiley. 1971.

Livros modernos que devem ser consultados:

Cameron, A. e Trivedi, P. Microeconometrics. Cambridge University Press. 2005.
Charemza, W. e Deadman, D. New Directions in Econometric Practice.
Davidson, R. e Mackinnon, J. Econometric Theory and Method. Oxford U. Press. 2004.
Enders, W. Applied Econometrics Time Series. John Willey & Sons. 1995.
Favero, C. Applied Macroeconometrics. Oxford U. Press. 2001.
Lütkepohl, H. New Introduction to Multiple Time Series Analysis. Springer. 2005.
Patterson, K. An Introduction to Applied Econometrics. Macmillan Press. 2001.
Ruud, P. Classical Econometric Theory. Oxford U. Press. 2001.
Wooldridge, Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. MIT Press. 1999.

Livros em Teoria da Probabilidade que podem ser consultados:

Billingsley, P. Convergence of Probability Measures. John Wiley. 1968.
Davidson, J. Stochastic Limit Theory. Oxford University Press. 1994.
Dhrymes, P. Topics in Advanced Econometrics – Probability Foundations. Springer-Verlag. 1989.
Spanos, A. Probability Theory and Statistical Inference. Cambridge U. Press. 1999.


José Jansas Souza
Secretário do Departamento
de Economia Aplicada
FEUC