



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 Christensen-Ravenkar
4. Testes para modelos não-entrelaçados

III. Dados em Painel 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.

- Johnston, 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:

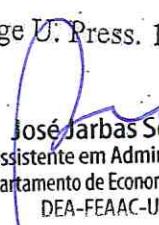
- Amemiya, T. *Advanced Econometrics*. Harvard U. Press. 1985.  
Dhrymes, P. *Econometrics: Statistical Foundations and Applications*. Harper & Row. 1970.  
Fisk, P. *Stochastic Dependent Equations*. Charles Griffin & Co. 1967.  
Goldberg, A. S. *Econometric Theory*. John Wiley. 1964.  
Graybill, F. *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. *Microeconomics*. 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 Macroeconomics*. 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, J. *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 Barbas Souza  
Assistente em Administração  
Departamento de Economia Aplicada  
DEA-FEAAC-UFC