

ECONOMETRIA II – EAE6030

Primeiro Semestre de 2024

Professor:	Claudio Lucinda	Horários:	2a 16:00 - 18:00/6a 14:00 - 16:00
Email:	claudiolucinda@usp.br		

Atendimento: Principalmente pelos fóruns do Moodle ou por agendamento via e-mail.

Pré-Requisitos: Esse curso será ministrado pressupondo conhecimentos cobertos em Econometria I. Noções de R/Stata/Python serão desejáveis

Objetivos de Aprendizado: Espera-se que, ao final do curso, o aluno desenvolva as seguintes habilidades:

- Entenda os princípios e propriedades dos estimadores discutidos
- Tenha comando sobre a implementação computacional destes estimadores
- Seja capaz de, caso necessário, adaptar estes estimadores para o seu problema de pesquisa.

Referências:

- HAYASHI, F. Econometrics, 2000.
- MITTELHAMMER, Ron C.; JUDGE, George G.; MILLER, Douglas J. Econometric foundations pack with CD-ROM. Cambridge University Press, 2000.
- TRAIN, Kenneth E. Discrete choice methods with simulation. Cambridge university press, 2009.
- WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, 2010. (Second Edition.)
- MACKINNON, J.G e DAVIDSON, R. Econometric Theory and Methods, 2004.

Programa do Curso:

- A teoria dos estimadores de extremo. Consistência e normalidade assintótica. Testes de hipótese. Exemplo: estimadores de mínimos quadrados não lineares.
- O estimador de máxima-verossimilhança. Eficiência assintótica e a igualdade da matriz informacional. Teste de razão de verossimilhança.
- O método dos momentos generalizados para equações estruturais lineares e não lineares. A matriz de pesos ótima e testes de sobreidentificação.
- Modelos de resposta discreta. Modelos binomial (logit e probit) e multinomial.
- Modelos de resposta truncada (tobit tipo I, tobit tipo II).
- Bootstrap e Simulated Assisted Estimation

Sistemática de Avaliação: Média das Listas de exercício (40%), Prova (60%).

Programa Detalhado: Este é mais uma carta de intenções do que um contrato firme.

Data	Dia da Semana	Tema	Bibliografia
Data	Dia da Semana	Tema	Bibliografia
13/05/2024	Segunda-Feira	Extremum Estimator	Mittelhammer
17/05/2024	Sexta-Feira	Extremum Estimator	Mittelhammer
20/05/2024	Segunda-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
24/05/2024	Sexta-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
27/05/2024	Segunda-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
03/06/2024	Segunda-Feira	GMM	Hayashi
07/06/2024	Sexta-Feira	GMM	Hayashi
10/06/2024	Segunda-Feira	GMM	Hayashi
14/06/2024	Sexta-Feira	Discrete Choice Methods	Train
17/06/2024	Segunda-Feira	Discrete Choice Methods	Train
21/06/2024	Sexta-Feira	Discrete Choice Methods	Train
24/06/2024	Segunda-Feira	Simulação 02: Método dos Momentos Simulados/Ve-rossimilhança Simulada	Notas de aula
28/06/2024	Sexta-Feira	Simulação 01: Bootstrap	Notas de aula
01/07/2024	Segunda-Feira	TBD	Notas de Aula
05/07/2024	Sexta-Feira	Prova	Tudo