

# ECONOMETRIA II – EAE6030

Primeiro Semestre de 2023

---

<b>Professor:</b>	Claudio Lucinda	<b>Horários:</b>	2a 16:00 - 18:00/6a 14:00 - 16:00
<b>Email:</b>	<a href="mailto:claudiolucinda@usp.br">claudiolucinda@usp.br</a>		

---

**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
15/05/2023	Segunda-Feira	Extremum Estimator	Mittelhammer
19/05/2023	Sexta-Feira	Extremum Estimator	Mittelhammer
22/05/2023	Segunda-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
26/05/2023	Sexta-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
29/05/2023	Segunda-Feira	MLE	Davidson e Mackinnon
02/06/2023	Sexta-Feira	GMM	Hayashi
05/06/2023	Segunda-Feira	GMM	Hayashi
12/06/2023	Segunda-Feira	GMM	Hayashi
16/06/2023	Sexta-Feira	Discrete Choice Methods	Train
19/06/2023	Segunda-Feira	Discrete Choice Methods	Train
23/06/2023	Sexta-Feira	Discrete Choice Methods	Train
26/06/2023	Segunda-Feira	Simulação 02: Método dos Momentos Simulados/Ve-rossimilhança Simulada	Notas de aula
30/06/2023	Sexta-Feira	Simulação 01: Bootstrap	Notas de aula
03/07/2023	Segunda-Feira	TBD	Notas de Aula
07/07/2023	Sexta-Feira	Prova	Tudo