

## Formulário para apresentação de disciplina

---

Sigla da disciplina: LES5805

Nome da disciplina

Português: Econometria II

Inglês: Econometrics II

Espanhol: Econometría II

Em qual idioma a disciplina será ministrada?:  Português  Inglês

Programa/Área: [Economia Aplicada](#)

Nº da área: 11132

Validade inicial (Ano/Semestre): 2012/01

Nº de créditos: 8

Carga horária semanal (horas):

Aulas Teóricas: 06

Aulas Práticas, Seminários e Outros: 02

Horas de Estudo: 04

Duração em semanas: 10

Docente(s) responsável(eis):

1. Ana Lucia Kassouf

Docente USP n.º 56020

Docente externo. Data de obtenção do título: \_\_\_\_\_ Instituição: \_\_\_\_\_

2.

Docente USP n.º \_\_\_\_\_

Docente externo. Data de obtenção do título: \_\_\_\_\_ Instituição: \_\_\_\_\_

3.

Docente USP n.º \_\_\_\_\_

Docente externo. Data de obtenção do título: \_\_\_\_\_ Instituição: \_\_\_\_\_

Custos reais da disciplina: R\$ \_\_\_\_\_

(Apresentar, se pertinente, orçamento previsto para o exercício, em folha anexa)

### PROGRAMA

#### OBJETIVOS

##### Português:

Familiarizar o aluno com métodos econométricos de grande aplicação em pesquisas econômicas, além da análise de regressão linear múltipla. É requisito para esta disciplina o conhecimento de estatística básica e análise de regressão linear múltipla.

##### Inglês:

Students will know econometric methods to apply in economic research. Statistics, Multiple regression

analyses, probability distribution and tests will be required in this course.

**Espanhol:**

Familiarizar al alumno con métodos econométricos de gran aplicación en investigaciones económicas, además del análisis de regresión lineal múltiple. Es requisito para esta disciplina el conocimiento de estadística básica y análisis de regresión lineal múltiple

**JUSTIFICATIVA**

**Português:**

A disciplina, optativa para o mestrado e essencial para o doutorado, apresenta os fundamentos teóricos e as aplicações práticas de modelos econométricos avançados utilizados em estudos na área econômica. A disciplina deverá capacitar o aluno a entender e utilizar as modernas técnicas de análise quantitativa em econometria.

**Inglês:**

This course, optional for master and mandatory for doctoral level shows the theoretical concepts and practical advanced econometric modeling used in economics. The course will prepare students to use techniques and quantitative analyses in econometrics. I will also teach students to model large data in microeconomic analyses.

**Espanhol:**

La disciplina, optativa para la maestría es esencial para el doctorado, presenta los fundamentos teóricos y las aplicaciones prácticas de modelos econométricos avanzados utilizados en estudios en el área económica. La disciplina deberá capacitar el alumno a entender y utilizar las modernas técnicas de análisis cuantitativo en econometría.

**CONTEÚDO/EMENTA**

**Português:**

Modelos para dados em painel ou que usam simultaneamente dados "cross-section" e séries temporais: heterocedasticidade, correlação contemporânea, autocorrelação, modelo de efeito fixo ou de variáveis binárias, modelo de efeito aleatório ou componente de erro, regressões aparentemente não correlacionadas (SUR), modelo de coeficiente aleatório de Swamy, testes; Regressão Não Linear: estimação por mínimos quadrados, estimação por máxima verossimilhança, testes assintóticos; Modelos com Variáveis Dependentes Qualitativas: próbite, lógite, tóbite, procedimento de Heckman, lógite multinomial.

**Inglês:**

Panel data model that use cross-section and time-series. Pooling data: heteroscedasticity, autocorrelation, contemporaneous correlation. Fixed effect model, random effect model, seemingly unrelated regression, error component model, non-linear models, maximum likelihood estimation, probit, logit, multinomial logit, tobit, asymptotic tests. Impact evaluation analyses: random control trial, diff in diff, propensity score matching, regression discontinuity.

**Espanhol:**

Modelos para datos en panel o que usan simultáneamente datos "cross-section" y series temporales: heterocedasticidad, correlación contemporánea, auto correlación, modelo de efecto fijo o de variables binarias, modelo de efecto aleatorio o componente de error, regresiones aparentemente no correlacionadas (SUR), modelo de coeficiente aleatorio de Swamy, pruebas; Regresión no Linear: estimación por mínimos cuadrados, estimación por máxima verosimilitud, pruebas asintóticos; Modelos con Variables Dependientes Cualitativas: próbit, lógit, tóbit, procedimiento de Heckman, lógit multinomial.

**Bibliografia:**

ALTAGI, B.H. Econometric analysis of Panel Data. 2nd edition, John Wiley & Sons. 2002.

CAMERON, A.C. e P.K. TRIVEDI. Microeconometrics. Methods and Applications. Cambridge University

Press. 2005.

DEATON, A. The analysis of Household Surveys. A Microeconomic Approach to Development Policy. Johns Hopkins University Press. 1997.

GREENE, W.H. Econometric Analysis, 5a. edição, Macmillian Publishing Company, 2003.

JUDGE, G., W. GRIFFITHS, R. HILL, R. LUTKEPOHL e H. LEE. Introduction to the Theory and practice of Econometrics, John Wiley & Sons, 1988.

JUDGE, G., W. GRIFFITHS, R. HILL, R. LUTKEPOHL e H. LEE. The Theory and Practice of Econometrics, John Wiley & Son, 1988.

KENNEDY, P. A Guide to Econometrics. 5a. edição, Blackwell Publishers, 2003.

MADDALA, G. Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics. New York: Cambridge University Press, 1999.

WOOLDRIDGE, J.M. Econometric analysis of Cross Section and Panel Data. 2nd edition. Massachusetts. The MIT Press. 2007.

### **CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO (máximo 160 caracteres)**

#### **Português:**

As provas serão com consulta e a matéria acumulativa. A nota final será a média das provas e do trabalho:

1ª Prova-peso 2; 2ª Prova-peso 2; Trabalho-peso 1

#### **Inglês:**

The tests will be with consultation and cumulative matter. The final score is the average of the tests and work:

1 st test-weight 2; 2nd test-weight 2; Work-weight 1

#### **Espanhol:**

Las pruebas serán con consulta y la materia acumulativa. La nota final será la media de las pruebas y del trabajo: 1ª Prueba-peso 2; 2ª Prueba-peso 2; Trabajo-peso 1

#### **Observações:**