

Universidade de Brasília

Pós-Graduação em Economia

Econometria 2

Prof. Victor Gomes

Home Page: www.victorgomes.net

Email: victorgomes@unb.br

Programa

Ementa

O objetivo desse curso é aprofundar e aprimorar a análise econométrica que foi introduzidos no curso de Econometria 1. Os tópicos do curso podem ser divididos em dois grupos: identificação e previsão. Na parte de identificação o foco do curso será nas várias classes de estimadores GMM. O curso inicia com o estimador tradicional de variáveis instrumentais até a definição e implementação dos estimadores não lineares (Chamberlain, 1987). Na parte de identificação também serão apresentados estimadores de escolha discreta e estimador de mínimo quadrado não linear.

Métodos de previsão são divididos em dois grupos: métodos paramétricos de séries de tempo e métodos não paramétricos. Métodos não paramétricos introduzem alguns estimadores de aprendizado de máquina.

Avaliações e Menções

Avaliação: duas provas escritas (pesos iguais): 50% da nota final; dois exercícios empíricos (pesos iguais): 50% da nota final. Menção: sistema padrão da Universidade de Brasília.

Cronograma

Estimadores GMM

- Hayashi, cap. 3 e 4.
- Angrist and Pischke, cap. 4

Logit, GEV e Probit

- Train, cap. 3, 4 e 5
- Hayashi, cap. 8

Máxima Verosimilhança e Métodos Não Lineares

- Train, cap. 8
- Hayashi, cap. 7
- Judd, cap. 5
- Chamberlain (1987)
- Andrews, Gentzkow, and Shapiro (2017)

Séries de Tempo: Testes e Previsão

- Hansen, cap. 14 e 15
- Hayashi, cap. 9 e 10

Métodos Não Paramétricos

- Hansen, cap. 18 e 19
- Hastie, Tibshirani e Friedman, cap. 4 e 5.

Bibliografia

1. Andrews, Isaiah, Matthew Gentzkow, and Jesse Shapiro. "Measuring the Sensitivity of Parameter Estimates to Estimation Moments." *Quarterly Journal of Economics*, 2017.
2. Angrist, Joshua and Jorn-Steffen Pischke, *Mostly Harmless Econometrics*. Princeton, Princeton University Press, 2009.
3. Chamberlain, Gary, "Asymptotic Efficiency in Estimation with Conditional Moment Restrictions," *Journal of Econometrics*, 34 (3), 1987.
4. Judd, Kenneth L. *Numerical Methods in Economics*. Cambridge, MIT Press, 1998.
5. Hansen, Bruce E. *Econometrics*. 2018. <https://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/>
6. Hastie, Trevor, Robert Tibshirani e Jerome Friedman. *The Elements of Statistical Learning: Data Mining, Inference, and Prediction*. 2nd ed. Springer, 2013. (<http://statweb.stanford.edu/~tibs/ElemStatLearn/>)
7. Hayashi, Fumio. *Econometrics*. Princeton, Princeton University Press, 2000.
8. Train, Kenneth. *Discrete Choice Methods with Simulation*. 2nd ed. Cambridge, Cambridge University Press, 2009. <https://eml.berkeley.edu/books/choice2.html>