**Faculdade de Economia, Administração e Contabilidade de Ribeirão Preto**

**Disciplina: REC2312 - Econometria II**

**Objetivos**

Apresentar as principais metodologias utilizadas para lidar com o problema de heteroscedasticidade, especificação da forma funcional e de dados, além de sua detecção formal e conseqüências para a estimação de mínimos quadrados ordinários. Estudar e apresentar formas para lidar com os casos em que as variáveis explicativas são endógenas e o caso especial de endogeneidade por simultaneidade. Introdução aos modelos com variáveis dependentes limitadas e uso de dados em painel.

**Programa**

1. Problemas de Especificação e de Dados

1.1. Testes de especificação

1.2. Variáveis Proxy

1.3. Erros de Medida

1.4. Amostras Não-Aleatórias e Observações Atípicas

2. Variáveis Instrumentais e Mínimos Quadrados de Dois Estágios

2.1. Propriedades das Variáveis Instrumentais

2.2. Estimação

2.3. Testes de Endogeneidade e de Restrições Sobreidentificadoras

3. Modelos de Equações Simultâneas

3.1. Viés de Simultaneidade

3.2. Identificação

4. Modelos com Variáveis Dependentes Limitadas

4.1. Modelo de Probabilidade Linear Revisitado

4.2. Modelo Logit

4.3. Modelo Probit

4.4. Modelo Tobit

4.5. Modelo de Seleção de Heckman

5. Estimação com Dados em Painel

**Avaliação**

Prova 1 – 20% - dia 28/08/2019

Prova 2 – 20% - dia 30/09/2019

Prova 3 - 30% - dia 30/10/2019

Prova 4 - 30% - dia 25/11/2019

**Bibliografia**

WOOLDRIDGE, J.M. Introdução a Econometria: uma abordagem moderna - tradução da 4a edição norte-americana. Cengage Learning, 2011

JOHNSTON, J.; DINARDO,J. Econometric Methods, 4ª Ed., McGraw-Hill, 1997

EQUIPE DE PROFESSORES DA USP. Manual de Econometria: nível intermediário. São Paulo: Editora Atlas, 1999.

GRIFFITHS, W.; HILL, C.; JUDGE, G. Econometria. 3a edição - Editora Saraiva, 2010.

GUJARATI, D.N.; PORTER, D. Econometria Básica. Bookman Editora, 2011.

KLEIBER, C.; ZEILEIS, A. Applied Econometrics with R (Use R!). Springer, 2008.

PINDYCK, R.; RUBINFELD, D. Econometria: modelos e previsões. Elsevier, 2004.

STOCK, J.; WATSON, M. Econometria. Pearson, 2004.