

Econometria

Por R. J. Wonnacot & T. H. Wonnacot. Rio de Janeiro, Livros Técnicos e Científicos S.A., 1976. Trad. de Maria C. Silva. Ed. original: **Econometrics**. John Wiley & Sons, 1970.

O livro em apreço, há muito tempo estava sendo esperado em português. Até agora só dispúnhamos do livro do Johnston (Editora Atlas) que é ótimo para um segundo curso (mais avançado) de econometria ou para quem já tenha bons conhecimentos de inferência estatística e de álgebra linear. O livro de Wonnacott é de nível intermediário (requer conhecimentos básicos de estatística) e tem seu grande mérito na sua didática excepcional. O texto é dividido em duas partes bem distintas: econometria elementar e econometria mais adiantada.

A primeira parte motiva o estudante de imediato, expondo-lhe problemas simples de regressão por mínimos quadráticos para, pouco a pouco, apresentar a maioria dos problemas encontrados em econometria. Os conhecimentos de estatística são apresentados à medida que os problemas de econometria os requer. Esta parte procura extrair o máximo para o aprendizado de econometria, sem exigir

conhecimentos de álgebra linear. Esta técnica de apresentar a teoria de estatística somente à medida que vai sendo necessária contrapõe-se a uma alternativa de massacrar o estudante com teoria de estatística e álgebra linear e a seguir mostrar com que facilidade um indivíduo bem preparado resolve os problemas de econometria — como fazem alguns livros europeus. A didática desta parte é magistral e segue a filosofia de primeiro fazer com que o estudante entenda os problemas da econometria sem dispersar seus esforços com problemas adicionais de estatística e de matemática.

A segunda parte retoma o estudo da anterior empregando álgebra linear e melhores conhecimentos de estatística (com ótima revisão no capítulo 14). Obviamente, graças a estas ferramentas muito mais poderosas, chega a detalhes mais avançados. O nível de abstração é bem maior, entretanto, utilizando ilustrações muito felizes, os autores conseguem fazer sentir o significado dos equacionamentos matemáticos.

O livro poderia ter sido um pouco mais completo se tivesse apresentado na primeira parte mais exemplos sobre equações simultâneas e justificasse melhor o método dos mínimos quadráticos de dois estágios. Na segunda parte, esperar-se-ia mais detalhes sobre séries temporais (por exemplo, noções de análise espectral) e estimativas com restrições lineares. Tanto na edição americana como na brasileira, após o capítulo 10 vem o capítulo 13, sem explicação alguma da razão.

Quanto à tradução, parece ter sido feita com caprichos. Evidentemente, há certas falhas como na página 128, onde na sexta linha, de baixo para cima, aparece "perturbação" em vez de "erro" e na página 179, onde deveria ser "P" em lugar de "p"

e vice-versa. Estes cochilos são inevitáveis e não devem de modo algum invalidar a qualidade do trabalho da tradutora. ■

Pierre J. Ehrlich