



Disciplina: Econometria I

Carga Horária: 60 horas

Créditos: 4

Natureza: Obrigatória

Ementa: Conceitos fundamentais da econometria clássica: Mínimos Quadrados (LS) – Propriedades em Pequena Amostra; LS – Propriedades em Grandes Amostras; violação das hipóteses básicas da econometria clássica: heterocedasticidade, autocorrelação serial, multicolinearidade, simultaneidade. Estimadores de GMM; Estimadores Extremos; Máxima Verossimilhança e seus exemplos.

Conteúdo Programático:

1. Modelo de Regressão Linear;
2. Estimador de MQO e suas Propriedades;
3. Inferência e Testes de Hipótese;
4. Violação das Hipóteses do Modelo de Regressão Linear;
5. Estimador de Variáveis Instrumentais e de Mínimos Quadrados em Dois Estágios;
6. Estimadores de Extremo;
7. GMM: modelos lineares;
8. Máxima Verossimilhança;
9. Introdução aos modelos de dados em painel.

Bibliografia:

HAYASHI, F. Econometrics, 2000.

WOOLDRIDGE, J.M. Econometric Analysis of Cron Section and Panel Data. MIT Press. 2002.

GREENE, W. Econometric Analysis. Pearson, 8th edition, 2018.