

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. Estimadores de GMM; Máxima Verossimilhança e seus exemplos. Variáveis instrumentais.

Bibliografia: GREENE, W.H. *Econometric Analysis*, 7ª edição, Macmillan Publishing Company, 2012. GRIFFITHS, R., R. HILL e G. JUDGE. *Learning and Practicing Econometrics*, John Wiley & Sons, 1993. GOLDBERGER, A. *A Course in Econometrics*. Harvard Univ. Press; July 1991. Hayashi, F. *Econometrics*, Princeton University Press, 2000. JUDGE, G., W. GRIFFITHS, R. HILL, R. LUTKEPOHL e H. LEE. *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, John Wiley & Sons, 1988. WOOLDRIDGE, J.M. *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. MIT Press. 2002. WOOLDRIDGE, J.M. *Introductory Econometrics. A Modern Approach*. 2nd ed. Ed. Thomson. 2003.