

## PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA – MESTRADO E DOUTORADO

**Disciplina:** ECN/903 – Econometria I

**Período:** 1º semestre - 2023

**Carga Horária/Créditos:** 60/04

**Professora:** Ana Hermeto

### Programa

1. Elementos e Pressupostos do Modelo de Regressão Linear; Estimador de Mínimos Quadrados Ordinários; Aspectos algébricos dos mínimos quadrados; Propriedades estatísticas dos MQO em amostras finitas e em grandes amostras (assintóticas); Inferência e testes de hipóteses
2. Violação das Hipóteses do Modelo de Regressão Linear: multicolinearidade, heterocedasticidade, autocorrelação dos resíduos
3. Endogeneidade, Estimador de Variáveis Instrumentais e de Mínimos Quadrados em Dois Estágios
4. Introdução ao Método dos Momentos; GMM: modelos lineares e modelos não lineares
5. Máxima Verossimilhança: testes assintóticos, LIML e FIML; Máxima Verossimilhança Simulada e Método dos Momentos Simulados
6. Introdução aos modelos para variáveis dependentes discretas e limitadas
7. Problemas de especificação, análise de resíduos e observações influentes; Bootstrapping

### Bibliografia

Davidson, R., Mackinnon, J. (2009) *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press.

Greene, W. H. (2017) *Econometric Analysis*. 2017. Prentice Hall. (8ª ed.)

Hansen, B. (2022) *Econometrics*. Princeton University Press.

Hayashi, F. (2000) *Econometrics*. Princeton University Press.

Kennedy, P. (2008) *A Guide to Econometrics*. Wiley-Blackwell. (6ª ed.)

Verbeek, M. (2017) *A Guide to Modern Econometrics*. Wiley. (5ª ed.)

Wooldridge, J. M. (2010) *Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*. MIT Press. (2ª ed.)

### Avaliação

Exercícios Práticos	20
Prova Intermediária I	25
Prova Intermediária II	25
Prova Final	30
Total	100