

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

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

**Período:** 1º semestre – 2024

**Carga Horária/Créditos:** 60/04

**Professora:** Ana Hermeto

### Programa

1. Introdução: estratégias de identificação de causalidade; introdução/revisão sobre pacotes estatísticos e bases de dados para aplicações
2. 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
3. Violação das Hipóteses do Modelo de Regressão Linear: multicolinearidade, heterocedasticidade, autocorrelação dos resíduos
4. Endogeneidade, Estimador de Variáveis Instrumentais e de Mínimos Quadrados em Dois Estágios
5. Introdução ao Método dos Momentos; GMM: modelos lineares e modelos não lineares
6. Máxima Verossimilhança: testes assintóticos, LIML e FIML; Máxima Verossimilhança Simulada e Método dos Momentos Simulados
7. Introdução aos modelos para variáveis dependentes discretas e limitadas
8. Problemas de especificação, análise de resíduos e observações influentes; Bootstrapping

### Bibliografia Básica

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.

Heiss, F. (2020) *Using R for Introductory Econometrics*. (2<sup>nd</sup> ed.)

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

Trabalhos Intermediários (4) / Apresentação (1)	80
Trabalho Final / Apresentação	20
Total	100