

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA/MESTRADO/UFSC

Professor: Guilherme Moura /

Identificação da Disciplina:

Nome: CNM3303 - Econometria I

Carga Horária: 60 h

EMENTA: Revisão de estatística e álgebra matricial; análise de regressão linear e não linear; teste de hipóteses; intervalos de confiança; mínimos quadrados generalizados: heterocedasticidade e autocorrelação; variáveis instrumentais; método generalizado dos momentos.

Pré-Requisitos: Conhecimentos básicos de econometria em linguagem matricial tais como os contidos em Gujarati, D. *Econometria Básica*. Rio de Janeiro: Elsevier, 2006.

Objetivo: O objetivo deste curso é revisar o modelo clássico de regressão, apresentar modelo de regressão generalizado, estimação pelo método generalizado dos momentos e por máxima verossimilhança. Tem-se também como meta capacitar o aluno a ler e entender artigos científicos que utilizam métodos econométricos.

Programa:

1. Modelo Clássico de Regressão.
2. Geometria do Modelo Clássico de Regressão.
3. Propriedades Estatísticas do Método de Mínimos Quadrados.
4. Teste de Hipóteses no Modelo Clássico de Regressão.
5. Intervalos de Confiança.
6. Modelo de Regressão Não-Linear.
7. Modelo de Regressão Generalizado.
8. Variáveis Instrumentais.
9. Método Generalizado dos Momentos.
10. Método de Máxima Verossimilhança.

Bibliografia Obrigatória:

Davidson, R. e Mackinnon, J.G. *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press. 2009

Bibliografia Suplementar:

Greene, W.H. *Econometric Analysis*. New York, Macmillan Publishing Company. 1993.
Amemiya, T. (1985) *Advanced Econometrics*, Basil Blackwell, Oxford.

Avaliação: A nota final será uma média ponderada da nota obtida em listas de exercícios (40%) e em uma prova final (60%).