

**UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SOCIOECONÔMICO
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA**

DISCIPLINA: ECONOMETRIA I
CÓDIGO: CNM 3127

CARGA HORÁRIA: 60h - CRÉDITOS: 04

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.

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; método da máxima verossimilhança.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

Davidson, R. e Mackinnon, J.G. **Econometric Theory and Methods**. Oxford University Press. 2009..
Hayashi, F. **Econometrics**. New Jersey, Princeton University Press. 2000.
Mittelhammer, R. **Mathematical Statistics for economics and Business**. Springer, 2013.