



## PLANO DE ENSINO

### I. IDENTIFICAÇÃO

Disciplina: **ECONOMETRIA I**

Código: CNM310027

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

Professor: André Alves Portela Santos (<https://sites.google.com/site/andreportela/>)

Contato: andre.portela@ufsc.br

Horário de Atendimento/Local: Através de videoconferência – agendar por e-mail.

### II. EMENTA

Breve 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, estimação por máxima verossimilhança.

### III. OBJETIVOS

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.

### IV. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

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.

### V. METODOLOGIA DE ENSINO E APRENDIZAGEM

A metodologia de ensino está baseada em atividades remotas síncronas e assíncronas.

As atividades síncronas serão conduzidas através da plataforma *Google Meet* mediante um link de acesso enviado pelo professor. As atividades síncronas ocorrerão no mesmo horário previsto para a disciplina ou em outro horário que mais conveniente desde que combinado previamente entre professor e estudantes.



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA  
CENTRO SOCIOECONÔMICO  
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA E RELAÇÕES INTERNACIONAIS  
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA

As atividades remotas assíncronas são compostas por vídeo-aulas gravadas e atividades avaliativas.

Todo o material didático utilizado nas atividades síncronas e assíncronas serão disponibilizados integralmente na plataforma Moodle.

## VI. AVALIAÇÃO

A avaliação será composta por:

- 2 Atividades assíncronas que ocorrerão na forma de prova *take-home* em que cada estudante terá um prazo de 24h para resolver a prova e postar suas soluções na plataforma Moodle usando o recurso *arefa*. A primeira avaliação ocorrerá em meados do semestre ao passo que a segunda avaliação ocorrerá ao final do semestre. Cada avaliação representa 40% da nota final.
- Listas de exercícios, que contarão como 20% da nota final.

## VII. CRONOGRAMA

A disciplina terá duração de 12 semanas. Em cada semana, será visto um tópico da disciplina. Na quinta semana ocorrerá a primeira atividade avaliativa. A décima primeira semana será dedicada à segunda atividade avaliativa. A décima segunda semana será dedicada para a realização de uma avaliação global da disciplina e para a discussão/debate a respeito de tópicos mais promissores para a pesquisa de ponta em Econometria.

## VIII. BIBLIOGRAFIA

### Básica:

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

### Complementar:

Greene, W.H. *Econometric Analysis*. New York, Macmillan Publishing Company. 1993

Amemiya, T. (1985) *Advanced Econometrics*, Basil Blackwell, Oxford.