

# UERJ EMENTA DA DISCIPLINA

UNIDADE ACADÊMICA **Faculdade de Ciências Econômicas**

DEPARTAMENTO **DAQ**

CÓDIGO NOME DA DISCIPLINA **Econometria I**

( x ) obrigatória

( x ) eletiva

CH 60 CRÉD 04

PROGRAMA DISTRIBUIÇÃO DE CARGA HORÁRIA Pós-Graduação Ciências Econômicas

TIPO DE AULA C. HORÁRIA Nº CRÉDITOS

CURSO TEÓRICA 60 04

Mestrado PRÁTICA - -

Doutorado TOTAL 60 04

PRÉ-REQUISITO: Métodos quantitativos em economia I

CÓDIGO EMENTA

1) O modelo de regressão simples: os estimadores de mínimos quadrados, propriedades amostrais dos estimadores de mínimos quadrados;

2) O modelo de regressão múltipla: variância e eficiência (Teorema de Gauss-Markov) e distribuição assintótica dos estimadores de mínimos quadrados;

3) Testes de hipóteses e de especificação dos modelos de regressão múltipla; correlação serial e heterocedasticidade dos resíduos;

4) Modelos de equações simultâneas: identificação, métodos de estimação com informação limitada (variáveis instrumentais, GMM, mínimos quadrados em dois estágios, máxima verossimilhança com informação limitada),

5) Métodos de estimação de sistemas de equações (mínimos quadrados em três estágios, máxima verossimilhança com informação completa, GMM);

6) Regressões com variáveis defasadas: modelos ADL e modelos VAR;

7) Modelos de regressão não lineares;

8) Modelos com variável dependente discreta;

9) Modelos com variável dependente limitada.

## BIBLIOGRAFIA BASICA

1) Green, William H. 2011. Econometric Analysis. Prentice Hall. 7a. edição.

2) Stock, James H e Watson, Mark M. 2010. Introduction to Econometrics. Pearson Education Inc. 3a. ed.

3) Rudd, Paul A. 2000. An Introduction to Classical Econometric Theory. Oxford University Press. New York.

4) Wooldridge, Jeffrey M. 2009. Introductory Econometrics: A Modern Approach. South Western Cengage Learning. Mason, OH - USA.

PROFESSOR PROPONENTE  
DATA ASSINATURA/MAT.

  
COORDENADOR DO PROGRAMA  
DATA ASSINATURA/MAT.

05/01/2021

38945-2