



Universidade do Estado de Santa Catarina – UDESC
Centro de Ciências da Administração e Socioeconômicas – ESAG
Direção de Pesquisa e Pós-Graduação
Programa de Pós-Graduação em Economia

DISCIPLINA OBRIGATÓRIA

Econometria (4 Créditos):

Revisão de estatística: modelos de probabilidade, distribuições discretas e contínuas, distribuições amostrais, estimação de parâmetros e testes de hipóteses paramétricos. Modelo de Mínimos Quadrados Ordinários: estimador de MQO, teoria assintótica. Violação dos pressupostos do modelo clássico de regressão linear: heterocedasticidade, autocorrelação, erro de medida, simultaneidade e endogeneidade. Mínimos Quadrados Generalizados. Variáveis instrumentais. Método generalizado dos momentos. Método da máxima verossimilhança.

Bibliografia Básica:

ANGRIST, J.; PISCHKE, J. S. Mostly harmless econometrics: an empiricist's companion. Princeton: Princeton University Press, 2009.

CASELLA, G.; BERGER, R. Inferência estatística. 2. ed. Rio de Janeiro: Cengage Learning, 2010.

GREENE, W. Econometric analysis. 8. ed. [S. l.]: Pearson, 2018.

HAYASHI, F. Econometrics. Princeton: Princeton University Press, 2000.

MEYER, P. L. Probabilidade: aplicações à estatística. 2. ed. Rio de Janeiro: LTC, 1983.

WOOLDRIDGE, J. M. Econometric analysis of cross section and panel data. 2. ed. Cambridge: MIT Press, 2010.