

## CE631 – Econometria I

Os Símbolos no final de cada ítem indicam os capítulos correspondentes, com **A** representando o livro “Análise de Regressão” e **H** representando o livro de Hill et alii.

- Introdução: Econometria e Economia; modelos **H1**.
- Revisão de conceitos estatísticos básicos: variável aleatória, distribuição, Esperança matemática, amostra, parâmetros e estimadores, métodos de obtenção de estimadores, propriedades dos estimadores (incluindo propriedades assintóticas) e teste de hipóteses. **A1 e H2**.
- Correlação e Regressão Linear Simples. **A2-3 e H3-6**.
- Observação: A partir do próximo ítem supõe-se que o aluno conheça álgebra de matrizes (vetores e Matrizes; soma, multiplicação, transposição e inversão de matrizes; característica ou posto de uma matriz).
- Regressão Linear Múltipla. **A4 e H7-8**.
- Uso de variáveis binárias. **A5 e H9**.
- Análise harmônica (Apostila).
- Heterocedasticia. **A6 e H10**.
- Autocorrelação nos erros. **A7 e H11**.
- Equações simultâneas. **A9 e H13**.
- Séries Temporais. **H16** e apostila.

### BIBLIOGRAFIA

- **HOFFMANN, R.** Estatística para Economistas, 3ª ed., São Paulo, Editora Pioneira, 1998.
- **HOFFMANN, R. e VIEIRA, S.** Análise de Regressão: uma Introdução à Econometria, 3ª ed. São Paulo, Editora HUCITEC, 1998 ( o livro está esgotado, mas uma versão preliminar de nova edição estará disponível em forma de apostila).
- **HOFFMANN, R.** Análise Harmônica, ESALQ, DEAS, Série Didática nº 99, 1995.
- **HILL, C; GRIFFITHS, W. e JUDGE, G.** Econometria, São Paulo, Saraiva, 1999.
- **JOHNSTON, J. e DINARDO, J.** Econometric Methods, 4ª ed., McGraw-Hill, Internacional Editions, 1997.
- **WONNACOTT, R. J. e WONNACOTT, T. H.** Econometria, Rio de Janeiro, Livros Técnicos e Científicos, 1976.
- **LANGE, O.** Introdução à Econometria, 2º ed. Rio de Janeiro, Fundo de Cultura, 1967.

**MADDALA, G. S.** Introduction to Econometrics, Macmillan, 1988.