

PÓS-GRADUAÇÃO – Ementa de disciplina
Mestrado e Doutorado em Economia

DISCIPLINA: Estatística II SIGLA: ESTII	CÓDIGO: MDPEEC003
PROFESSOR: Marcelo Jovita Moreira	CARGA HORÁRIA: 40h CRÉDITOS: 4
OBRIGATORIA: <input checked="" type="checkbox"/> SIM <input type="checkbox"/> NÃO	CURSO: <input type="checkbox"/> M <input type="checkbox"/> D <input checked="" type="checkbox"/> MD
PRÉ-REQUISITO:	
ÁREA DE CONCENTRAÇÃO: Estatística e Econometria	
<p>EMENTA</p> <p>Curso de Estatística II</p> <p>Este é um curso MA/ PhD em estatística e teoria econométrica. Os tópicos a serem abordados incluem estatísticas suficientes (CB 6); estimação pontual (CB 7); teste de hipóteses (CB 8); teoria assintótica (CB 5); álgebra matricial (G 14), ordinário estimador de mínimos quadrados (G 15-17); inferência (G 18-22) em modelos de regressão linear, generalizada estimador de mínimos quadrados (G 26-28), regressão não linear (G 29), e um método generalizado dos momentos. Normalmente, a classe se reúne às segundas-feiras e sextas-feiras (normalmente, 11:00-13:00), e as sessões são às quartas-feiras (horário a combinar).</p> <p>Haverá 4 listas de exercícios. No cálculo de sua nota total, o grau mais baixo de 4 conjuntos de problemas será descartado. O assistente dará um grau de 10 para cada aluno (PS). A nota não vai contar na nota geral, se a nota final for melhor. Você receberá uma nota de 40 no exame de médio prazo (MT) e uma nota de 50 no exame final (FI). A classificação global curso vai ser determinada pela seguinte fórmula: $CG = \max(PS, 1/5 * FI) + MT + FI$</p>	
<p>OBJETIVOS</p> <p>O objetivo do curso de Estatística II é fornecer um panorama geral dos métodos e técnicas utilizadas correntemente em econometria. Pré-requisitos para o curso são: álgebra linear e estatística I. A primeira parte do curso apresentará conceitos básicos de teoria assintótica, estimação, e testes de hipóteses. A segunda parte do curso cobrirá estimador de mínimos quadrados, inferência em modelos de regressão lineares, estimador generalizado de mínimos quadrados, e regressão não linear.</p>	
<p>BIBLIOGRAFIA</p> <p>Livros</p> <p>Casella, G. and R. Berger, Statistical Inference. [CB]</p> <p>Goldberger, A., A Course in Econometrics. [G]</p> <p>Outros livros recomendados:</p>	

PÓS-GRADUAÇÃO – Ementa de disciplina
Mestrado e Doutorado em Economia

Hayashi, F., Econometrics. [H]

Wooldridge, J., Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. [W]