



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE CAMPINAS

Instituto de Economia

HO-235 – Econometria de Dados em Painel

Professor Alexandre Gori Maia (gori@unicamp.br) – IE/UNICAMP

PROGRAMA

Ementa:

Disciplina de econometria aplicada com ênfase à análise de causalidade e modelos para dados em painel. Serão abordados os tópicos: (1) revisão de regressão múltipla; (2) regressão e causalidade; (3) modelos para dados em painel, estimação e inferência de modelos que consideram efeitos fixos e aleatórios para indivíduos e/ou tempo, tópicos avançados em econometria de dados em painel.

Carga horária: 60 h

Programa

- 1 Revisão de regressão linear (12 h)
 - a. Manipulação de base de dados
 - b. Regressão múltipla e estimadores de MQO
 - c. Análise da qualidade do ajuste
 - d. Formas funcionais
 - e. Variáveis binárias
- 2 Regressão e causalidade (16 h)
 - a. Viés de variável omitida
 - b. Viés de seleção
 - c. Variáveis instrumentais
 - d. Mínimos quadrados em dois estágios
- 3 Análise de dados em painel (32 h)
 - a. Modelos com dados empilhados
 - b. Coeficientes angulares interativos
 - c. Efeitos fixos e efeitos aleatórios
 - d. Modelos de diferença em diferença
 - e. Modelos dinâmicos de dados em painel
 - f. Modelos de dados em painel com variável dependente binária
 - g. Estimadores robustos

Objetivos

O objetivo do curso é apresentar conceitos fundamentais da análise de regressão e orientar o aluno no desenvolvimento de pesquisas que envolvam a avaliação de impactos e análise de dados em painel, apresentando seus principais fundamentos e aplicações.

Metodologia

Aulas expositivas com aplicações dos conceitos através de exercícios de análise econômica. Serão apresentados exemplos nos programas estatísticos R.

Avaliação

Elaboração de trabalho final com aplicação de econometria de dados em painel. O trabalho deve conter a contextualização do problema, metodologia, resultados e conclusões. O tamanho máximo do trabalho é de 15 páginas.

Referências

Revisão de regressão linear

MAIA, A. G. **Econometria: conceitos e aplicações**. Editora Saint Paul, 2017.

Regressão e causalidade

ANGRIST, J.; PISCHKE, J. **Mostly harmless econometrics: An empiricist's Companion**. Princeton University Press, 2009.

Análise de Dados em Painel

BALTAGI, B. H. **Econometric analysis of Panel Data**. 2nd edition, John Wiley & Sons. 2002.

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of Cross Section and Panel Data**. 2nd edition. Massachusetts. The MIT Press. 2007.