



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE CAMPINAS

Instituto de Economia

HO-235 – Econometria de Dados em Painel

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

Marcelo Justus (mjustus@unicamp.br) – IE/UNICAMP

Stella Schons do Valle (szschons@vt.edu) – Virginia Tech

PROGRAMA

Ementa:

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

Carga horária: 60 h

Aulas remotas: 19 a 23 de julho de 2021

Elaboração de trabalho final: 26 a 30 de julho de 2021

Programa

- 1 Revisão de regressão linear
 - a. Manipulação de base de dados
 - b. Regressão múltipla e estimadores de MQO
 - c. Análise da qualidade do ajuste
- 2 Causalidade e Avaliação de Impactos
 - a. Conceito de experimento
 - b. Viés de omissão
 - c. Variáveis instrumentais
 - d. Métodos de Pareamento
- 3 Análise de dados em painel
 - a. Modelos com dados empilhados
 - b. Efeitos fixos e efeitos aleatórios
 - c. Coeficientes angulares interativos
 - d. Estimadores robustos e MQG (Heterocedasticidade e Autocorrelação)

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 análises de resultados de um ajuste de regressão sobre tema relacionado ao curso e de interesse do aluno. O conceito final considerará a qualidade do trabalho e participação em sala de aula.

Formato do trabalho:

- Aproximadamente 10 páginas, fonte Times New Roman, tamanho 12, espaçamento 1,5 entre linhas.
- Tabelas com fonte Times New Roman, tamanho 10 a 12 (não copiar como imagem), título numerado no cabeçalho, rodapé contendo fonte dos dados;

Estrutura do trabalho:

- Introdução: descrevendo justificativa do estudo, objetivo e breve descrição do método de análise e apresentação dos resultados;
- Método de análise: descrevendo fonte dos dados, variáveis, transformações, modelo econométrico e técnica de análise;
- Resultados: apresentando e descrevendo principais resultados das análises econométricas;
- Considerações finais: discussão das principais conclusões do trabalho.
- Bibliografia: artigos, livros e documentos utilizados incluídos como referências no texto.

Referências básicas

Revisão de regressão linear

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

Causalidade e Avaliação de Impactos

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.