



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE CAMPINAS

Instituto de Economia

HO-235 – Econometria de Dados em Pannel

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

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 presenciais: de 1 a 5 de julho de 2019 – Sala SPD1

Elaboração de trabalho final: de 10 a 12 de julho de 2019

Horário: 8:30h às 12h30 e das 14h às 18h00

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 SAS, Stata, R e Python. O aluno optará por um dos programas para desenvolvimento de seus exercícios e trabalho final.

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 Paineis

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.