



UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO GRANDE - FURG
INSTITUTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS, ADMINISTRATIVAS E
CONTÁBEIS/ICEAC
MESTRADO EM ECONOMIA APLICADA/PPGE



Disciplina: Microeconometria

Prof^ª. Dr^ª. Vivian dos Santos Queiroz / Prof. Dr. Rafael Mesquita

Carga Horária: 45 horas/aulas

Obrigatória: Sim

Crédito: 3 créditos

EMENTA:

Modelos de Equações Simultâneas: Equações Aparentemente não Relacionadas, O Problema da Identificação, Estimação de Dois Estágios, Três Estágios e Máxima Verossimilhança Completa. Método de variáveis instrumentais; Modelos de dados em Cross-Section: Modelos Probabilístico Linear, Modelos Probit e Logit e testes não entrelaçados, Truncagem, Dados Censurados e o Modelo Tobit; Modelos com Dados em Painel Estático: Agregado, Efeitos Fixos, Aleatórios e Heterogeneidade não Observada. Os Testes de Hausman e Breusch-Pagan e Painel dinâmico; Tópicos Avançados: Regressões Quantílicas; Modelo de Heckman, Regressão de Poisson e Binomial negativo.

OBJETIVO:

O objetivo dessa disciplina é dar suporte ao aluno de pós-graduação com o instrumental de estatística aplicada à economia, apresentando algumas das principais metodologias utilizadas em microdados, afim de auxiliar na construção de trabalhos científicos e dissertações.

SISTEMA DE AVALIAÇÃO:

A avaliação será realizada com base em listas de exercícios e a realização de trabalho científico e prova.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

UNIDADE 1 – Modelo de equações simultâneas

1.1 Sistema de equações;

1.2 Endogeneidade e Causalidade;

1.3 Identificação;

1.4 MQ2Estágios e MQ3Estágios;

UNIDADE 2 – Variável Instrumental – IV

2.1 O Método dos Mínimos Quadrados – MQO em dois estágios e o IV;

2.2 Questões que envolvem o uso do IV;

2.3 Aplicações com IV e suas dificuldades;

UNIDADE 3 – Modelos de Cross-Section

3.1 Introdução;

3.2 Variáveis Binárias;

3.3 Modelos Logit binomial e multinomial;

3.4 Modelos Probit binomial e multinomial;

3.5 Modelos censurados Tobit;

UNIDADE 4 – Modelos de dados em Painel

4.1 Hipóteses de definição;

4.2 Estimadores;

4.3 Modelos Lineares;

4.4 Modelo de Painel Agregado - Pool;

4.5 Modelo de Painel com Efeitos Fixos – EF;

4.6 Modelo de Painel com Efeitos Aleatórios – EA;

4.7 Teste de Hausman-Pagan;

4.8 Teste de Breush;

UNIDADE 5 – Painel Dinâmico

5.1 Hipótese de identificação;

5.2 Estimador Arellano-Bond;

5.3 Estimador Arellano-Bover;

5.4 Estimador Blundell-Bond;

UNIDADE 6 – Tópicos Avançados

6.1 Regressões Quantílicas;

6.2 Modelo de Heckman;

6.3 Regressão de Poisson e Binomial negativo;

BIBLIOGRAFIA

ANGRIST, J.; KRUEGER, A. Empirical strategies in labor economics., In O. Ashenfelter e D. Card, (eds.) Handbook of Labor Economics, v.3.

Amsterdam:Elsevier, 1999.

ARELLANO, M. Panel Data Econometrics. Oxford: Oxford University Press, 2003.

BALTAGI, B. Econometric Analysis of Panel Data. Chichester:John Wiley, 1995.

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. Microeconometrics: methods and applications. Cambridge: CUP, 2005.

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. Microeconometrics using Stata. Stata Press, 2009.

DAVIDSON, R.; McKINNON, J. Estimation and Inference in Econometrics. New York:Oxford University Press, 1993.

GREENE, W. Econometric Analysis, 4rd ed. New York:Macmillan, 2000.

HSIAO, C. Analysis of Panel Data. Cambridge University Press, 2003.

JOHNSTON, J.; DINARDO, R. Econometric Methods, 3rd.ed. New York:McMillan, 1998.

KENNEDY, P. A Guide to Econometrics, 3rd ed.. Cambridge, MA:MIT Press, 1992.

KOENKER, R. Quantile Regression. Cambridge:University Press, 2006.

LONG, S. L.; FREESE, J. Regression Models for Categorical Dependent Variables Using Stata. Stata Press, 2006.

WOOLDRIDGE, J. The Econometrics of Cross Section and Panel Data. MIT Press, 2000.