



EC00931 – Tópicos Especiais em Econometria

CH: 60 horas/aula

Créditos: 04

Docente: Tatiane Almeida de Menezes

Objetivo

O objetivo desse curso é a apresentação dos principais métodos econométricos aplicados a microdados. O foco do curso será tanto teórico como prático de forma a dar ao aluno experiência no manejo das principais bases de dados brasileiras, assim como familiarização com os principais pacotes de softwares econométricos existentes. Para tanto, o curso está dividido em duas partes. A primeira parte faz uma apresentação teórica dos métodos econométricos e sua interpretação. A segunda parte está voltada para aplicações práticas de tais métodos utilizando as bases de dados brasileiras.

Programa

Introdução

Modelos com dados em painel

1. Efeitos Aleatórios, Efeitos Fixos: Teste de Hausman e modelos robustos a heterocedasticidade
2. Primeiras Diferenças e Painel Dinâmico
3. GMM
4. Pseudopainel

Experimentos Quase Aleatórios

5. Estimation of Average Treatment Effects Under Unconfoundedness.
6. Difference-in-Differences Estimation
7. Regression Discontinuity Designs

Econometria Espacial (6 aulas)

8. O processo da dependência espacial.
9. Interpretação dos modelo sem econometria espacial
10. Estimação e inferência estatística
11. Painel espacial

Método de Avaliação

Nota Final: [Prova 1 + Lista de exercícios+ Trabalho] / 3

Referências Bibliográficas

BIBLIOGRAFIA BÁSICA:

1. Cameron C. e Trivedi, P. *Microeconometrics: Theory and Application*, Cambridge University Press, 2005.
2. Wooldridge, Jeffrey “*Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*”, MIT Press, 2002.
3. James LeSage and R. Kelley Pace, *Introduction to Spatial Econometrics*. Taylor & Francis Group, 2009

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

1. Introdução

RODRIK, Dani. The New Development Economics: We Shall Experiment, but How Shall We Learn? RWP08-055, October, 2008.

COHEN, Jessica; EASTERLY, William (Ed.). *What works in development?: Thinking big and thinking small*. Brookings Institution Press, 2010.

2. Modelos com dados em painel

Angrist (1991). “Grouped –Data Estimation and Testing in Simple Labor Supply Models”. *Journal of Econometrics*, vol. 47 , 243-266.

Arellano e Bond (1991). “Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo, Evidence and an Application to Employment Equations”, *Review of Economic Studies*, vol. 58.

Azzoni, C., Menezes-Filho, N., Menezes, T., Silveira-Neto, R. (2000) “Geography and income convergency among Brazilian States. Working Paper IDB, May.

Blundel, Duncan e Meghir “Estimation of Labor Supply Responses using Tax Reforms” *Econometrica*, 66, 4, 1998.

Browning, Deaton e Irish. (1985). “A Profitable Approach to Labor Supply and Commodity Demands over the Life Cycle”. *Econometrica*, vol. 59 503-44.

Greene, W. (2000) *Econometric Analysis*, 4a edição Prentice Hall, capítulo 14 - “Models for Panel Data”

Islam (1997) “Growth Empirics : A Panel Data Approach”. *Quarterly Journal of Economics*, vol. 110, 1127-1170.

Levitt (1997) “Using Electoral Cycles in Police Hiring to Estimate the Effect of Police on Crime”. *American Economic Review*, 87.

Moffit (1993). “Identification and Estimation of Dynamic Models with a Time Series of Repeated Cross-Sections”. *Journal of Econometrics*, vol. 59, 99-123.

Terra, M. C. “Credit Constraints in Brazilian Firms: Evidence from Panel Data” *Revista Brasileira de Economia*, vol. 57, no. 2, pp. 443-464, 2003.

3. Experimentos Quase Aleatórios

- Angrist, J.D., G.W. Imbens and D.B. Rubin (1996), “Identification of Causal Effects Using Instrumental Variables,” *Journal of the American Statistical Association*, 91, 444-472.
- Angrist, J.D. and A.B. Krueger, (1991), Does Compulsory School Attendance Affect Schooling and Earnings?, *Quarterly Journal of Economics* 106, 979-1014.
- Dehejia, R. (2005) “Program Evaluation as a Decision Problem,” *Journal of Econometrics*, 125, 141-173.
- Engle, R., D. Hendry, and J.-F. Richard, (1983) “Exogeneity,” *Econometrica*, 51(2): 277-304.
- Imbens, G., and J. Angrist (1994), “Identification and Estimation of Local Average Treatment Effects,” *Econometrica*, Vol. 61, No. 2, 467-476.
- Rubin, D., (1990), “Formal Modes of Statistical Inference for Causal Effects”, *empJournal of Statistical Planning and Inference*, 25, 279-292.

4. EconometriaEspacial

- Kelejian HH, Prucha IR (1998) A generalized spatial two stage least squares procedure for estimating a spatial autoregressive model with autoregressive disturbances. *J Real Estate Finance Econ* 17(1):99–121
- Elhorst JP Dynamic spatial panels: models, methods, and inferences. *J GeogrSyst* (2012) 14:5–28.
- Elhorst JP (2010a) Spatial panel data models. In: Fischer MM, Getis A (eds) *Handbook of applied spatial analysis*. Springer, Berlin, Heidelberg and New York, pp 377–407.
- Elhorst JP (2010b) Matlab software for spatial panels. Paper presented at 4th world conference of the spatial econometric association, Chicago
- Elhorst JP (2010c) Applied spatial econometrics: raising the bar. *Spatial Econ Anal* 5(1):9–28.
- Ertur, C., and Koch W (2007) Growth, technological interdependence and spatial externalities: theory and evidence. *J ApplEcon* 22(6):1033–1062