



Disciplina: HO: 237 Turma A - Microeconometria

Professor: Marcelo Justus

Oferta: 2º/2018

Objetivo

O objetivo é discutir as questões metodológicas da estimação de modelos econométricos com microdados. Especificamente, o intuito é apresentar com profundidade e rigor estatístico os principais tópicos da microeconometria, sobretudo os modelos e métodos aplicados na fronteira da econometria aplicada com grandes amostras de dados *cross section*. Trata-se de um *curso avançado para alunos aprovados na disciplina de Econometria (HO231)* ou equivalente em outros programas de pós-graduação. Esse curso também é parcialmente útil como preparação para a disciplina “Econometria de Dados em Pannel” (HO235).

Ementa

Leitura e manipulação de microdados. Sistema de regressão linear. Regressão linear com variáveis instrumentais. Regressão Quantílica. Modelos de resultados binários. Modelos multinomiais. Modelos Tobit e de Seleção. Modelos de dados em contagem. Aplicações.

Programa

1. Microdados
 - 1.1. Dicionário e leitura
 - 1.2. Manipulação, filtros e criação de variáveis.
 - 1.3. Desenho amostral e pesos.
2. Sistema de regressão linear – SUR
3. Regressão linear com variáveis instrumentais.
 - 3.1. Instrumentos
 - 3.2. Estimação IV: IV, 2SLS, GMM
 - 3.3. Testes para variável endógena
 - 3.4. Testes de validade de instrumentos
 - 3.5. Estimação IV com um regressor binário endógeno
 - 3.6. Instrumentos fracos
 - 3.7. Análise de sensibilidade para a escolha de instrumentos
4. Regressão Quantílica
5. Modelos de resultados binários
 - 5.1. Probit
 - 5.2. Logit
 - 5.3. Regressores endógenos
6. Modelos multinomiais
 - 6.1. Logit multinomial
 - 6.2. Probit multinomial
 - 6.3. Logit ordenado
 - 6.4. Probit ordenado

- 6.5. Probit bivariado
- 7. Regressão para dados censurados
 - 7.1. Modelos Tobit
 - 7.2. Procedimento de Heckman
 - 7.3. Probit com seleção amostral
- 8. Modelos de dados em contagem
 - 8.1. Poisson
 - 8.2. Binomial negativo
 - 8.3. Binomial negativo com zeros inflados

Sistema de avaliação

A avaliação do rendimento do aluno será baseada em frequência, provas e trabalho. Para aprovação o aluno deverá ter frequência de, no mínimo, 75%. A avaliação será composta por uma prova e um artigo, respectivamente, com pesos 60% e 40%. A prova será individual e o artigo em dupla/trio. O trabalho será a produção e apresentação de um artigo científico utilizando uma (ou mais) das técnicas econométricas apresentadas. O artigo deve ter a estrutura básica dos artigos publicados em revistas científicas (isto é, Introdução, Referencial Teórico e/ou Revisão de Literatura, Metodologia, Resultados, Conclusão, Referências, Anexos/Apêndices), deve ser escrito em LaTeX e ter no máximo 15 páginas (com tabelas, bibliografia etc).

Bibliografia

- Amemiya, T. (1984). Tobit models: A survey. **Journal of Econometrics** 24 (1-2): 3-61.
- Angrist, J. D. and Pischke, J. S. (2008). **Mostly harmless econometrics: An empiricist's companion**. Princeton University Press.
- Bertrand, M., Duflo, E. and Mullainathan, S. (2004). How much should we trust differences-in-differences estimates?. **The Quarterly Journal of Economics** 119 (1): 249-275.
- Bertrand, M., Duflo, E. and Mullainathan, S. (2004). How much should we trust differences-in-differences estimates? . **The Quarterly Journal of Economics** 119 (1): 249-275.
- Cameron, A. C. and P. K. Trivedi (2005). **Microeconometric: Methods and applications**. Cambridge University Press.
- Cameron, A. C. and Trivedi, P. K. (2010). **Microeconometric using Stata**, Revised 2nd Edition. Stata Press.
- Dehejia, R. H. and Wahba, S. (1999). Causal effects in nonexperimental studies: Reevaluating the evaluation of training programs. **Journal of the American Statistical Association** 94 (448): 1053-1062.
- Dehejia, R. H. and Wahba, S. (2002). Propensity score-matching methods for nonexperimental causal studies. **Review of Economics and Statistics** 84 (1): 151-161.
- Deaton, A. (1997) The analysis of household surveys: **A microeconomic approach to development policy**. Work Bank: The Johns Hopkins University Press.
- Diaz, J. J. and Handa, S. (2006). An assessment of propensity score matching as a nonexperimental impact estimator: Evidence from Mexico's PROGRESA Program. **Journal of Human Resources** 41 (2): 309-345.
- Duflo, E., Glennerster, R. and Kremer, M. (2008). In T. Paul Schultz and John A. Strauss (ed.). Using randomization in development economics research: A toolkit. **Handbook of Development Economics** 4 (5). Elsevier
- Greene, W. H. (2011). **Econometric Analysis**, 7rd Edition. Prentice Hall.
- Guo, S. and Fraser, M. W. (2014). **Propensity score analysis: Statistical methods and applications**. Sage Publications.
- Heckman, J. J. (1979). Sample selection bias as a specification error. **Econometrica** 47 (1): 153-161.
- Heckman, J. J., Ichimura, H. and Todd, P. E. (1997). Matching as an econometric evaluation Estimator: Evidence from evaluating a job training programme. **Review of Economic Studies** 64 (4): 605-54
- Hoffmann, R. and Kassouf, A. L. (2005). Deriving conditional and unconditional marginal effects in log earnings equations estimated by Heckman's procedure. **Applied Economics** 37 (11): 1303-1311.
- Imbens, G. W. and Lemieux, T. (2008). Regression discontinuity designs: A guide to practice. **Journal of Econometrics** 142 (2): 615-635.

- Rosenbaum, P. R. and Rubin, D. B. (1983). The central role of the propensity score in observational studies for causal effects. **Biometrika** 70 (1): 41-55.
- Schneider, W. (2005). Likelihood estimation for censored random vectors. **Econometric Reviews** 24 (2): 195-217.
- Scott Long, J. and Freese, J. (2014). **Regression models for categorical dependent variables using Stata**, 3rd Edition. Stata Press.
- Silva, P. L. N., Pessoa, D. G. C., Lila, M. F. (2002). Statistical analysis of data from PNAD: incorporating the sample design. **Ciênc. Saúde Colet.** 7 (4): 659-670.
- Smith, T. (1998). **Analysis of complex surveys**. John Wiley & Sons, Chichester.
- Van de Ven, W. P. M. M. V. and B. M. S. V. Praag (1981). The demand for deductibles in private health insurance: A probit model with sample selection. **Journal of Econometrics** 17 (2): 229-252.
- Wooldridge, J. M. (2010). **Econometric analysis of cross section and panel data**, 2nd Edition. The MIT Press.

Programa computacional

Stata®.

Atualizado em 28/06/2018.